

# 银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 17        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 18        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 18        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 18        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>19</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 19        |
| 6.2 利润表                                 | 20        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 21        |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 22        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>45</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 45        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 45        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 46        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 49        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 52        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....    | 53        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 53        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 53        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....    | 53        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 53        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 53        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 53        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>55</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 55        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 55        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....     | 55        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>56</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>57</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 57        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....      | 57        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 57        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 57        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 57        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....         | 57        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 57        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 60        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>63</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....    | 63        |

---

|                           |           |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... | 63        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>    | <b>64</b> |
| 12.1 备查文件目录.....          | 64        |
| 12.2 存放地点.....            | 64        |
| 12.3 查阅方式.....            | 64        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 银华多元动力灵活配置混合        |
| 基金主代码      | 005251              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2017 年 12 月 14 日    |
| 基金管理人      | 银华基金管理股份有限公司        |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 255,950,814.84 份    |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                     |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金将在努力控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过多元化的配置策略，积极优选全市场的投资机会，整体性布局于具有核心竞争力及比较有优势的的行业和公司，同时追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的长期稳定增值。                                     |
| 投资策略   | 本基金坚持“多元动力”的投资理念。所谓“多元动力”即指在不同的市场阶段采取相应的多元化收益策略，积极寻求各细分市场以及个股、个券的投资机会，力争实现基金资产的稳定回报。<br>本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%                                                                                                                      |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金及货币市场基金。                                                                                                             |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                        | 基金托管人                  |
|---------|------|------------------------------|------------------------|
| 名称      |      | 银华基金管理股份有限公司                 | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨文辉                          | 张燕                     |
|         | 联系电话 | (010) 58163000               | 0755-83199084          |
|         | 电子邮箱 | yhjj@yhfund.com.cn           | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4006783333, (010) 85186558   | 95555                  |
| 传真      |      | (010) 58163027               | 0755-83195201          |
| 注册地址    |      | 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 办公地址    |      | 北京市东城区东长安街 1 号               | 深圳市深南大道 7088 号招商银      |

|       |                       |        |
|-------|-----------------------|--------|
|       | 东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层 | 行大厦    |
| 邮政编码  | 100738                | 518040 |
| 法定代表人 | 王珠林                   | 缪建民    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                 |
|---------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券日报》                                                          |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所                                                   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                                |
|--------|--------------|-------------------------------------|
| 注册登记机构 | 银华基金管理股份有限公司 | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 87,643,054.23                          |
| 本期利润          | 77,204,969.53                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.3185                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 14.03%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 13.80%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配利润      | 283,592,037.66                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.1080                                 |
| 期末基金资产净值      | 635,054,704.55                         |
| 期末基金份额净值      | 2.4812                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末( 2021 年 6 月 30 日 )                |
| 基金份额累计净值增长率   | 148.12%                                |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去一个月          | 4.85%        | 0.99%               | -0.90%             | 0.40%                 | 5.75%   | 0.59% |
| 过去三个月          | 14.58%       | 1.03%               | 2.42%              | 0.49%                 | 12.16%  | 0.54% |
| 过去六个月          | 13.80%       | 1.41%               | 1.44%              | 0.66%                 | 12.36%  | 0.75% |
| 过去一年           | 52.68%       | 1.47%               | 14.18%             | 0.66%                 | 38.50%  | 0.81% |
| 过去三年           | 168.38%      | 1.37%               | 32.92%             | 0.67%                 | 135.46% | 0.70% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 148.12%      | 1.30%               | 26.52%             | 0.66%                 | 121.60% | 0.64% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*50%+中债综合指数收益率\*50%。

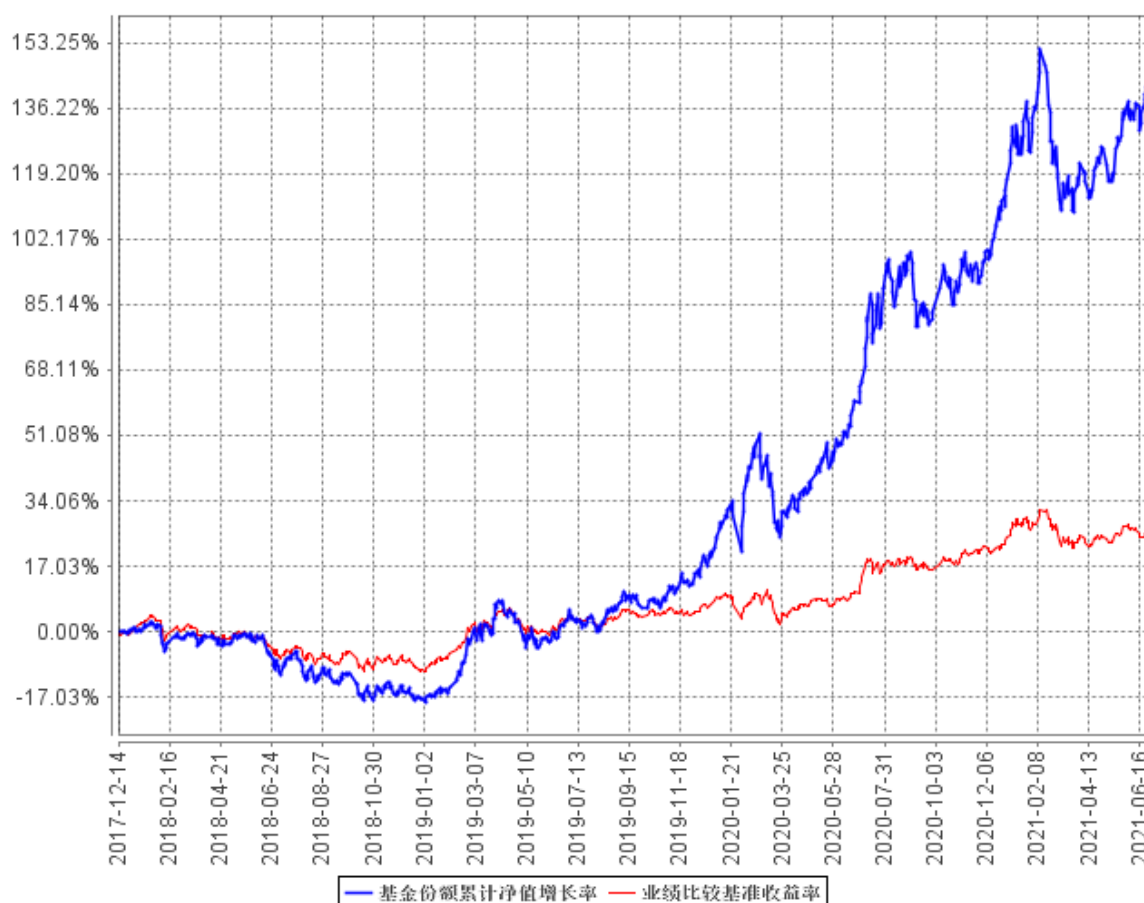
沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数；该



指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。综合考虑到本基金大类资产的配置情况和指数的代表性，本基金选择沪深 300 指数和中债综合指数的加权平均作为本基金的投资业绩比较基准。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业有限公司 0.90%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 149 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投资基金 (LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银

华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟

39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华长江经济带主题债券型证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名   | 职务     | 任本基金的基金经理（助理）<br>期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                      |
|------|--------|---------------------|------|--------|-----------------------------------------|
|      |        | 任职日期                | 离任日期 |        |                                         |
| 贾鹏先生 | 本基金的基金 | 2017 年 12 月 14 日    | -    | 12.5 年 | 硕士学位，2008 年 3 月至 2011 年 3 月期间任职于银华基金管理有 |

|  |    |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|----|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 经理 |  |  |  | <p>限公司，担任行业研究员职务；2011 年 4 月至 2012 年 3 月期间任职于瑞银证券有限责任公司，担任行业研究组长；2012 年 4 月至 2014 年 6 月期间任职于建信基金管理有限公司，担任基金经理助理。2014 年 6 月起任职于银华基金管理有限公司，自 2014 年 8 月 27 日至 2017 年 8 月 7 日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自 2014 年 8 月 27 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2014 年 9 月 12 日至 2020 年 5 月 21 日兼任银华增值证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月 31 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 1 日至 2017 年 7 月 5 日兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 5 月 19 日起兼任银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 8 月 8 日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 14 日起兼任银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 1 月 29 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 6 日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 2 月 19 日起兼任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 10 日起兼任银华多元机遇混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 8 日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 15 日起兼任银华多元回报一年持</p> |
|--|----|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|       |          |                  |   |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-------|----------|------------------|---|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|       |          |                  |   |        | 有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 王智伟先生 | 本基金的基金经理 | 2020 年 11 月 20 日 | - | 11.5 年 | 硕士学位。曾就职于天相投资顾问有限公司、中国证券报有限责任公司、方正证券股份有限公司，2015 年 6 月加盟银华基金管理有限公司，曾任基金经理助理职务。自 2016 年 7 月 26 日至 2019 年 7 月 5 日担任银华合利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 7 月 26 日至 2019 年 3 月 2 日兼任银华双动力债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 11 月 20 日起兼任银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 27 日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管

理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年 A 股市场经历大幅波动，结构分化加剧。上半年 A 股市场受美债利率和通胀扰动，流动性预期不断变化，市场波动加剧，总体看，上半年周期与成长占优，金融地产等相对落后，行业层面，电气设备、钢铁和化工行业涨幅居前，家用电器、非银金融和国防军工跌幅较大。市场结构分化较大，行业呈现轮动的特征。整体看疫情控制的节奏低于预期，影响了全球经济复苏节奏，进而流动性宽松的程度也超出我们预期。

上半年，本基金根据市场预期的变化延续了再平衡的操作，对于高估值板块有一定减仓，加仓了部分顺周期但估值不高的板块，较好的控制了回撤。此外，结合行业趋势变化和业绩预期，选取了一些具备性价比的标的进行布局。后半程则结合基本面行业比较，再次优化了行业配置结构，总体看目前相对均衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.4812 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.80%，业绩比较基准收益率为 1.44%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济有压力也有韧性，货币政策能够保持较宽松的状态，市场预计仍以结构性行情为主。（1）经济复苏情况较弱，但基本面有一定韧性。今年在基数效应下国内经济与企业盈利前高后低，但下半年看国内整体的基本面趋势逐步转弱，而外需以及制造业投资仍能

持续，此外财政后置下基建支出也存在加码空间，整体经济复苏有压力，也有韧性。（2）货币政策保持较为宽松的状态。当前国内终端需求偏弱、PPI-CPI 剪刀差持续扩大之下，中下游尤其是小微企业盈利面临的压力不断提升，货币政策相较前期预期已经有所宽松。不存在大幅收紧基础，而考虑到当前全球经济复苏节奏错位，新兴市场国家经济修复缓慢，下半年海外供需缺口仍存，而国内碳中和目标下大宗商品供给收缩压力难消，将使得通胀见顶回落而斜率预计较缓，货币政策继续大幅放松的可能性也较低，因此会保持在适度宽松的状态。（3）市场以结构性机会为主。考虑到当前经济修复边际放缓，货币政策不具备系统性收紧基础，认为市场仍然存在结构性机会，主要寻找业绩增长能够覆盖估值下行的标的。

下半年，本基金将更加注重持仓性价比，重点关注几个投资方向：（1）在核心资产中继续择优选择。近期核心资产虽然都上涨较多，目前估值重回较高位置，但是部分板块的产业趋势确定，基本面有可能继续超预期，这类标的仍然值得我们重点关注和配置。（2）在经济转型过程中涌现出的新成长赛道。我国的经济结构正在发生巨大变化，工程师红利以及消费升级促进了很多新兴行业的发展，如智能汽车、人工智能、预制菜、扫地机器人等，未来有望成为新的一批核心资产。

（3）关注 2020 年因疫情受损的可选消费品，如大众消费品、餐饮、酒店航空等板块。随着疫情的修复，这些板块的经营也有望同步恢复，并且业绩具备很大的弹性。近期虽然疫情反复影响了恢复进程，但是趋势不变，接下来一个季度仍然是布局的好机会。

2016 年 5 月 19 号，我们发行了银华多元视野这只产品。到这份半年报的时候，他的运作已经有五年的时间了。银华多元动力，是多元系列的第二只产品。非常感谢每一位持有人的陪伴。在这期间，我们探索了不同的投资框架，出发点是希望能提供给客户相对好的净值体验。这里面，也伴随着我们对投资的认识，有一个逐步升级的过程。在最开始的时候，我们继承了之前管理保本基金的做法，在一个较低的仓位下，通过个股选择和组合管理方法，努力实现净值相对平稳的上涨。大概在 2018 年前后，我们逐步提升了仓位中枢，逐步淡化择时，打磨能力圈。到目前为止，我们建立了相对稳定的投资框架，也形成了平衡稳健的投资风格。

这条路跟大部分同行的职业路径并不相同，非常感谢银华基金的领导和同事，给了我们最大的包容和帮助。我们也一直在努力学习公司内部优秀同事、市场上优秀同行的方法体系，完善自己的投资框架。资本市场在不断演化，产业格局在不断变迁，没有躺赢的投资方法。我们只能通过日复一日的积累，加深自己对重点行业和上市公司的理解，形成相对稳定的能力圈，才能获得合理的投资回报。同时，努力保持投资系统的开放性，也是一个重要的功课。接纳新的产业趋势，保持年轻的心态，才能让净值曲线走的更为长久。

对中国资本市场的长期前景，我们始终充满信心。从需求端来看，中国有着全球最大的市场。



我们的经济体已经处于消费主导的阶段，消费升级、新的消费形式构成消费增长的两大动力。在一些领域，我们人均消费水平还低于发达国家，对应的产品和服务，正处于快速增长的过程中。在另外一些领域，我们还有中国特有的产品和服务，有独特商业模式的公司存在。考虑到中国市场的体量和纵深，我们有理由对需求端带来的结构性机会保持乐观。

从供给端来看，中国在制造业方面的成本和规模优势长期存在，这些年甚至有扩大的趋势；同时，在很多行业，中国高素质人才的供应充足，形成了较为明显的工程师红利。这些优势在一些重大产业变革的时候，很容易实现重点行业的弯道超车，出现一批世界级的企业。供给和需求优势的结合，形成了中国产生优质上市公司的基础，这也是我们为投资者赚钱的最终来源。

大多数时候，我们都不是市场上耀眼的明星。投资不是百米跑，而是马拉松。我们希望自己步伐稳健，体力持久。感谢每一位持有人的信任。希望我们的工作，通过时间的累积，能够为您或大或小的生活梦想，增添一份持久的力量。在您的财富道路上，我们努力做一个靠谱的陪伴者。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 96,402,632.28                  | 27,183,354.57                    |
| 结算备付金           |            | 2,959,368.29                   | 2,406,641.06                     |
| 存出保证金           |            | 383,263.45                     | 411,803.80                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 531,613,348.90                 | 538,910,853.48                   |
| 其中：股票投资         |            | 497,189,347.50                 | 509,853,980.46                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 34,424,001.40                  | 29,056,873.02                    |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 5,433,890.41                   | 886,292.40                       |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 704,859.35                     | 611,358.17                       |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 137,293.69                     | 546,452.06                       |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 637,634,656.37                 | 570,956,755.54                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 9,813,803.47                     |
| 应付赎回款           |            | 591,612.55                     | 216,718.61                       |
| 应付管理人报酬         |            | 736,972.49                     | 664,303.38                       |
| 应付托管费           |            | 122,828.76                     | 110,717.21                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,042,915.47                   | 1,662,534.87                     |
| 应交税费            |            | -                              | 2.43                             |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 85,622.55      | 170,364.74     |
| 负债合计          |          | 2,579,951.82   | 12,638,444.71  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 255,950,814.84 | 256,067,087.29 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 379,103,889.71 | 302,251,223.54 |
| 所有者权益合计       |          | 635,054,704.55 | 558,318,310.83 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 637,634,656.37 | 570,956,755.54 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.4812 元，基金份额总额 255,950,814.84 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 86,525,321.45                            | 85,198,374.46                                 |
| 1.利息收入                |            | 411,973.17                               | 312,483.16                                    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 73,502.26                                | 53,687.64                                     |
| 债券利息收入                |            | 323,875.58                               | 258,795.52                                    |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |            | 14,595.33                                | -                                             |
| 证券出借利息收入              |            | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 96,370,649.03                            | 51,918,644.09                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 96,117,610.66                            | 50,018,049.02                                 |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | -1,148,574.67                            | -6,145.44                                     |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.3 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 1,401,613.04                             | 1,906,740.51                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -10,438,084.70                           | 32,731,050.72                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 180,783.95                               | 236,196.49                                    |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 9,320,351.92                             | 5,434,675.98                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 4,108,719.58                             | 2,128,633.57                                  |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 684,786.61                               | 354,772.30                                    |

|                     |          |               |               |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 3. 销售服务费            |          | -             | -             |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19 | 4,416,855.41  | 2,840,504.19  |
| 5. 利息支出             |          | 2,438.63      | 4,953.66      |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 2,438.63      | 4,953.66      |
| 6. 税金及附加            |          | 29.21         | 0.24          |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20 | 107,522.48    | 105,812.02    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 77,204,969.53 | 79,763,698.48 |
| 减：所得税费用             |          | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 77,204,969.53 | 79,763,698.48 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                |                 |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|-----------------|
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 256,067,087.29                             | 302,251,223.54 | 558,318,310.83  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 77,204,969.53  | 77,204,969.53   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -116,272.45                                | -352,303.36    | -468,575.81     |
| 其中：1.基金申购款                             | 79,500,351.99                              | 97,516,064.29  | 177,016,416.28  |
| 2.基金赎回款                                | -79,616,624.44                             | -97,868,367.65 | -177,484,992.09 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                          | -              | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 255,950,814.84                             | 379,103,889.71 | 635,054,704.55  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                 |

|                                        | 实收基金           | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
|----------------------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 176,435,035.15 | 38,721,012.50  | 215,156,047.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -              | 79,763,698.48  | 79,763,698.48  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 57,929,766.59  | 28,006,892.85  | 85,936,659.44  |
| 其中：1.基金申购款                             | 121,024,667.63 | 49,364,739.55  | 170,389,407.18 |
| 2.基金赎回款                                | -63,094,901.04 | -21,357,846.70 | -84,452,747.74 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -              | -              | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 234,364,801.74 | 146,491,603.83 | 380,856,405.57 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>王立新 | _____<br>凌宇翔 | _____<br>伍军辉 |
| 基金管理人负责人     | 主管会计工作负责人    | 会计机构负责人      |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2017】1759 号文《关于准予银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册并公开发行，由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起，于 2017 年 11 月 13 日至 2017 年 12 月 8 日向社会公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限为不定期，募集期间净认购资金总额为人民币 246,100,656.96 元，在募集期间产生的利息为人民币 170,714.78 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 246,271,371.74 元，折合 246,271,371.74 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所验证。经向中国证监会备案后，基金合同于 2017 年 12

月 14 日生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包含国债、金融债、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）；本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

(4) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳印花税;

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 96,402,632.28          |



|                |               |
|----------------|---------------|
| 定期存款           | -             |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -             |
| 存款期限 1-3 个月    | -             |
| 存款期限 3 个月以上    | -             |
| 其他存款           | -             |
| 合计：            | 96,402,632.28 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 420,674,418.85         | 497,189,347.50 | 76,514,928.65 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | 34,446,302.61  | 34,424,001.40 |
|               | 银行间市场                  | -              | -             |
|               | 合计                     | 34,446,302.61  | 34,424,001.40 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -             |
| 基金            | -                      | -              | -             |
| 其他            | -                      | -              | -             |
| 合计            | 455,120,721.46         | 531,613,348.90 | 76,492,627.44 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 6,003.91               |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 1,331.70               |
| 应收债券利息     | 697,351.24             |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |

|            |            |
|------------|------------|
| 应收买入返售证券利息 | -          |
| 应收申购款利息    | -          |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -          |
| 应收出借证券利息   | -          |
| 其他         | 172.50     |
| 合计         | 704,859.35 |

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,042,915.47           |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 1,042,915.47           |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 1,319.99               |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 84,302.56              |
| 合计          | 85,622.55              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 256,067,087.29                        | 256,067,087.29 |
| 本期申购          | 79,500,351.99                         | 79,500,351.99  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -79,616,624.44                        | -79,616,624.44 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                     | -              |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -              | -              |
| 本期申购          | -              | -              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -              | -              |
| 本期末           | 255,950,814.84 | 255,950,814.84 |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 193,628,009.16 | 108,623,214.38 | 302,251,223.54 |
| 本期利润           | 87,643,054.23  | -10,438,084.70 | 77,204,969.53  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,320,974.27   | -2,673,277.63  | -352,303.36    |
| 其中：基金申购款       | 77,720,856.41  | 19,795,207.88  | 97,516,064.29  |
| 基金赎回款          | -75,399,882.14 | -22,468,485.51 | -97,868,367.65 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 283,592,037.66 | 95,511,852.05  | 379,103,889.71 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 46,956.09                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 22,591.04                             |
| 其他        | 3,955.13                              |
| 合计        | 73,502.26                             |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,697,879,135.76                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,601,761,525.10                      |
| 买卖股票差价收入   | 96,117,610.66                         |

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,148,574.67              |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | -1,148,574.67              |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 54,155,390.59              |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 54,564,027.68              |
| 减：应收利息总额                | 739,937.58                 |
| 买卖债券差价收入                | -1,148,574.67              |

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

注：无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,401,613.04               |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                          |
| 基金投资产生的股利收益   | -                          |
| 合计            | 1,401,613.04               |

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -10,438,084.70                        |
| ——股票投资                     | -10,181,052.44                        |
| ——债券投资                     | -257,032.26                           |
| ——资产支持证券投资                 | -                                     |
| ——贵金属投资                    | -                                     |
| ——其他                       | -                                     |
| 2. 衍生工具                    | -                                     |
| ——权证投资                     | -                                     |
| 3. 其他                      | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估<br>增值税 | -                                     |
| 合计                         | -10,438,084.70                        |

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 154,073.59                            |
| 转换费收入   | 26,710.36                             |
| 合计      | 180,783.95                            |

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 4,416,855.41                          |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 交易基金产生的费用 | -                                     |
| 其中：申购费    | -                                     |
| 赎回费       | -                                     |
| 合计        | 4,416,855.41                          |

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 24,795.19                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 4,619.92                              |
| 债券帐户维护费 | 18,600.00                             |
| 合计      | 107,522.48                            |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金管理人于 2021 年 6 月 17 日发布《银华基金管理股份有限公司关于银华国际资本管理有限公司增加注册资本的公告》，银华基金管理股份有限公司（以下简称“母公司”）已完成对银华国际资本管理有限公司（以下简称“香港子公司”）的增资工作，母公司向香港子公司增加注册资本金共港币 7,000 万元。增资完成后，母公司维持持股比例 100%，共持股 1 亿股，香港子公司注册资本为 1 亿元港币。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称              | 与本基金的关系        |
|--------------------|----------------|
| 西南证券股份有限公司（“西南证券”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 银华基金管理股份有限公司       | 基金管理人、基金销售机构   |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金代销机构   |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 西南证券  | 277,409,615.54             | 8.43%            | 0.00                            | 0.00%            |

**6.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 西南证券  | 11,191,960.60              | 12.85%           | -                               | -                |

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                    | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                        |
|-------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|------------------------|
|       | 回购成交金额                     | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 | 回购成交金额                          | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比例 |
| 西南证券  | 22,400,000.00              | 15.40%             | -                               | -                      |

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |         |          |         |
|-------|----------------------------|---------|----------|---------|
|       | 当期佣金                       | 占当期佣金总量 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 |

|       |                                 | 的比例        |           | 总额的比例        |
|-------|---------------------------------|------------|-----------|--------------|
| 西南证券  | 202,865.21                      | 8.43%      | 52,197.62 | 5.00%        |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |            |           |              |
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 西南证券  | -                               | -          | -         | -            |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,108,719.58                   | 2,128,633.57                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 197,656.74                     | -                               |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 684,786.61                 | 354,772.30                      |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$



H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称                              | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                                  | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |                                  |
|------------------------------------|------------------------|----------------------------------|--------------------------|----------------------------------|
|                                    | 持有的<br>基金份额            | 持有的基<br>金份额<br>占基金总<br>份额的比<br>例 | 持有的<br>基金份额              | 持有的基<br>金份额<br>占基金总<br>份额的比<br>例 |
| 银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金(FOF) | 62,578.32              | 0.02%                            | —                        | —                                |
| 银华尊和养老目标日期 2035 三年持                | 2,755,711.23           | 1.08%                            | —                        | —                                |

|                             |  |  |  |  |
|-----------------------------|--|--|--|--|
| 有期混<br>合型基<br>金中基<br>金(FOF) |  |  |  |  |
|-----------------------------|--|--|--|--|

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方<br>名称 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |           |
|-----------|---------------------------------------|-----------|--------------------------------------------|-----------|
|           | 期末余额                                  | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 招商银行      | 96,402,632.28                         | 46,956.09 | 13,434,058.34                              | 36,320.80 |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |          |                        |                         |                      |          |            |                  |              |              |    |
|----------------------|----------|------------------------|-------------------------|----------------------|----------|------------|------------------|--------------|--------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日              | 可流<br>通日                | 流通<br>受限<br>类型       | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：<br>股) | 期末<br>成本总额   | 期末估值总额       | 备注 |
| 002607               | 中公教育     | 2021 年<br>2 月 2<br>日   | 2021<br>年 8<br>月 2<br>日 | 大宗<br>交易<br>流通<br>受限 | 37.10    | 20.10      | 135,000          | 5,008,500.00 | 2,713,500.00 | -  |
| 688617               | 惠泰医疗     | 2020 年<br>12 月<br>30 日 | 2021<br>年 7<br>月 7<br>日 | 新发<br>流通<br>受限       | 74.46    | 373.24     | 1,673            | 124,571.58   | 624,430.52   | -  |
| 688626               | 翔宇医疗     | 2021 年<br>3 月 23<br>日  | 2021<br>年 10<br>月       | 新发<br>流通             | 28.82    | 104.16     | 3,652            | 105,250.64   | 380,392.32   | -  |

|        |      |                  |                  |        |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------------|------------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 日                | 月 8 日            | 受限     |       |        |       |           |           |   |
| 688628 | 优利德  | 2021 年 1 月 22 日  | 2021 年 8 月 2 日   | 新发流通受限 | 19.11 | 32.62  | 2,789 | 53,297.79 | 90,977.18 | - |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021 年 3 月 18 日  | 2021 年 9 月 27 日  | 新发流通受限 | 47.33 | 251.96 | 345   | 16,328.85 | 86,926.20 | - |
| 688669 | 聚石化学 | 2021 年 1 月 15 日  | 2021 年 7 月 26 日  | 新发流通受限 | 36.65 | 32.39  | 2,681 | 98,258.65 | 86,837.59 | - |
| 300919 | 中伟股份 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 7 月 2 日   | 新发流通受限 | 24.60 | 163.00 | 427   | 10,504.20 | 69,601.00 | - |
| 688663 | 新风光  | 2021 年 4 月 6 日   | 2021 年 10 月 13 日 | 新发流通受限 | 14.48 | 19.21  | 3,279 | 47,479.92 | 62,989.59 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021 年 6 月 30 日  | 2021 年 7 月 9 日   | 新股流通受限 | 21.96 | 21.96  | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021 年 4 月 15 日  | 2021 年 10 月 26 日 | 新发流通受限 | 33.22 | 87.50  | 509   | 16,908.98 | 44,537.50 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021 年 6 月 28 日  | 2021 年 7 月 6 日   | 新股流通受限 | 10.64 | 10.64  | 3,789 | 40,314.96 | 40,314.96 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021 年 4 月 8 日   | 2021 年 10 月 15 日 | 新发流通受限 | 28.28 | 115.71 | 333   | 9,417.24  | 38,531.43 | - |
| 688367 | 工大高科 | 2021 年 6 月 21 日  | 2021 年 12 月 28 日 | 新发流通受限 | 11.53 | 17.94  | 1,717 | 19,797.01 | 30,802.98 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021 年 4 月 19 日  | 2021 年 10 月      | 新发流通   | 48.59 | 90.39  | 266   | 12,924.94 | 24,043.74 | - |

|        |          |                       |                           |                |       |       |       |           |           |   |
|--------|----------|-----------------------|---------------------------|----------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        |          | 日                     | 月 27<br>日                 | 受限             |       |       |       |           |           |   |
| 301009 | 可靠<br>股份 | 2021 年<br>6 月 8<br>日  | 2021<br>年 12<br>月 17<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 12.54 | 27.89 | 801   | 10,044.54 | 22,339.89 | - |
| 688226 | 威腾<br>电气 | 2021 年<br>6 月 28<br>日 | 2021<br>年 7<br>月 7<br>日   | 新股<br>流通<br>受限 | 6.42  | 6.42  | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |
| 300982 | 苏文<br>电能 | 2021 年<br>4 月 19<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 27<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 15.83 | 45.29 | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 | - |
| 300968 | 格林<br>精密 | 2021 年<br>4 月 6<br>日  | 2021<br>年 10<br>月 15<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 | - |
| 300940 | 南极<br>光  | 2021 年<br>1 月 27<br>日 | 2021<br>年 8<br>月 3<br>日   | 新发<br>流通<br>受限 | 12.76 | 43.38 | 307   | 3,917.32  | 13,317.66 | - |
| 300614 | 百川<br>畅银 | 2021 年<br>5 月 18<br>日 | 2021<br>年 11<br>月 25<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 9.19  | 40.38 | 329   | 3,023.51  | 13,285.02 | - |
| 300937 | 药易<br>购  | 2021 年<br>1 月 20<br>日 | 2021<br>年 7<br>月 27<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 12.25 | 53.71 | 244   | 2,989.00  | 13,105.24 | - |
| 301013 | 利和<br>兴  | 2021 年<br>6 月 21<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 29<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 8.72  | 27.11 | 471   | 4,107.12  | 12,768.81 | - |
| 300997 | 欢乐<br>家  | 2021 年<br>5 月 26<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 2<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 4.94  | 13.05 | 928   | 4,584.32  | 12,110.40 | - |
| 301002 | 崧盛<br>股份 | 2021 年<br>5 月 27<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 7<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 18.71 | 57.62 | 201   | 3,760.71  | 11,581.62 | - |
| 605287 | 德才<br>股份 | 2021 年<br>6 月 28<br>日 | 2021<br>年 7<br>月          | 新股<br>流通       | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.44 | 11,014.44 | - |

|        |          |                       |                           |                |       |       |       |          |           |   |
|--------|----------|-----------------------|---------------------------|----------------|-------|-------|-------|----------|-----------|---|
|        |          | 日                     | 月 6<br>日                  | 受限             |       |       |       |          |           |   |
| 300996 | 普联<br>软件 | 2021 年<br>5 月 26<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 3<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 20.81 | 42.23 | 241   | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 300956 | 英力<br>股份 | 2021 年<br>3 月 16<br>日 | 2021<br>年 9<br>月 27<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 12.85 | 25.80 | 371   | 4,767.35 | 9,571.80  | - |
| 300962 | 中金<br>辐照 | 2021 年<br>3 月 29<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 11<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 3.40  | 16.37 | 576   | 1,958.40 | 9,429.12  | - |
| 300952 | 恒辉<br>安防 | 2021 年<br>3 月 3<br>日  | 2021<br>年 9<br>月 13<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 11.72 | 27.08 | 340   | 3,984.80 | 9,207.20  | - |
| 300966 | 共同<br>药业 | 2021 年<br>3 月 31<br>日 | 2021<br>年 10<br>月 11<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 8.24  | 31.54 | 286   | 2,356.64 | 9,020.44  | - |
| 300945 | 曼卡<br>龙  | 2021 年<br>2 月 3<br>日  | 2021<br>年 8<br>月 10<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 4.56  | 18.88 | 474   | 2,161.44 | 8,949.12  | - |
| 300948 | 冠中<br>生态 | 2021 年<br>2 月 18<br>日 | 2021<br>年 8<br>月 25<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 13.00 | 27.42 | 324   | 2,808.00 | 8,884.08  | - |
| 300931 | 通用<br>电梯 | 2021 年<br>1 月 13<br>日 | 2021<br>年 7<br>月 21<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 4.31  | 13.11 | 672   | 2,896.32 | 8,809.92  | - |
| 300950 | 德固<br>特  | 2021 年<br>2 月 24<br>日 | 2021<br>年 9<br>月 3<br>日   | 新发<br>流通<br>受限 | 8.41  | 39.13 | 219   | 1,841.79 | 8,569.47  | - |
| 605162 | 新中<br>港  | 2021 年<br>6 月 29<br>日 | 2021<br>年 7<br>月 7<br>日   | 新股<br>流通<br>受限 | 6.07  | 6.07  | 1,377 | 8,358.39 | 8,358.39  | - |
| 300958 | 建工<br>修复 | 2021 年<br>3 月 18<br>日 | 2021<br>年 9<br>月          | 新发<br>流通       | 8.53  | 27.22 | 300   | 2,559.00 | 8,166.00  | - |

|        |      |                        |                           |                |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------------------|---------------------------|----------------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        |      | 日                      | 月 29<br>日                 | 受限             |       |       |     |          |          |   |
| 300986 | 志特新材 | 2021 年<br>4 月 21<br>日  | 2021<br>年 11<br>月 1<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020 年<br>12 月<br>29 日 | 2021<br>年 7<br>月 12<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 10.76 | 22.20 | 359 | 3,862.84 | 7,969.80 | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021 年<br>5 月 17<br>日  | 2021<br>年 11<br>月 24<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |
| 300930 | 屹通新材 | 2021 年<br>1 月 13<br>日  | 2021<br>年 7<br>月 21<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 13.11 | 24.48 | 322 | 4,221.42 | 7,882.56 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021 年<br>4 月 21<br>日  | 2021<br>年 10<br>月 29<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021 年<br>4 月 7<br>日   | 2021<br>年 10<br>月 15<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 18.24 | 28.29 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | - |
| 301004 | 嘉益股份 | 2021 年<br>6 月 18<br>日  | 2021<br>年 12<br>月 27<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 7.81  | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28 | - |
| 300991 | 创益通  | 2021 年<br>5 月 12<br>日  | 2021<br>年 11<br>月 22<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020 年<br>12 月<br>29 日 | 2021<br>年 7<br>月 7<br>日   | 新发<br>流通<br>受限 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021 年<br>4 月 14<br>日  | 2021<br>年 10<br>月 21<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 5.48  | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021 年<br>3 月 30       | 2021<br>年 10              | 新发<br>流通       | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |

|        |      |                       |                           |                |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|-----------------------|---------------------------|----------------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        |      | 日                     | 月 11<br>日                 | 受限             |       |       |     |          |          |   |
| 301011 | 华立科技 | 2021 年<br>6 月 9<br>日  | 2021<br>年 12<br>月 17<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021 年<br>2 月 3<br>日  | 2021<br>年 8<br>月 10<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 9.79  | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021 年<br>4 月 8<br>日  | 2021<br>年 10<br>月 19<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 7.19  | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021 年<br>3 月 22<br>日 | 2021<br>年 9<br>月 29<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021 年<br>6 月 28<br>日 | 2022<br>年 1<br>月 6<br>日   | 新发<br>流通<br>受限 | 10.64 | 10.64 | 421 | 4,479.44 | 4,479.44 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021 年<br>5 月 17<br>日 | 2021<br>年 11<br>月 26<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 301007 | 德迈仕  | 2021 年<br>6 月 4<br>日  | 2021<br>年 12<br>月 16<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 5.29  | 14.44 | 303 | 1,602.87 | 4,375.32 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021 年<br>5 月 25<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 2<br>日  | 新发<br>流通<br>受限 | 6.02  | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021 年<br>6 月 15<br>日 | 2021<br>年 12<br>月 22<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 8.05  | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021 年<br>6 月 9<br>日  | 2021<br>年 12<br>月 20<br>日 | 新发<br>流通<br>受限 | 7.83  | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，



因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人

定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月<br>30 日   | 1 个月以内         | 1-3 个月 | 3 个月-1 年     | 1-5 年      | 5 年以上      | 不计息            | 合计             |
|-----------------------------|----------------|--------|--------------|------------|------------|----------------|----------------|
| 资产                          |                |        |              |            |            |                |                |
| 银行存款                        | 96,402,632.28  | -      | -            | -          | -          | -              | 96,402,632.28  |
| 结算备付金                       | 2,959,368.29   | -      | -            | -          | -          | -              | 2,959,368.29   |
| 存出保证金                       | 383,263.45     | -      | -            | -          | -          | -              | 383,263.45     |
| 交易性金融资产                     | 30,217,000.00  | -      | 4,207,001.40 | -          | -          | 497,189,347.50 | 531,613,348.90 |
| 应收证券清算款                     | -              | -      | -            | -          | -          | 5,433,890.41   | 5,433,890.41   |
| 应收利息                        | -              | -      | -            | -          | -          | 704,859.35     | 704,859.35     |
| 应收申购款                       | 1,020.00       | -      | -            | -          | -          | 136,273.69     | 137,293.69     |
| 资产总计                        | 129,963,284.02 | -      | 4,207,001.40 | -          | -          | 503,464,370.95 | 637,634,656.37 |
| 负债                          |                |        |              |            |            |                |                |
| 应付赎回款                       | -              | -      | -            | -          | -          | 591,612.55     | 591,612.55     |
| 应付管理人报酬                     | -              | -      | -            | -          | -          | 736,972.49     | 736,972.49     |
| 应付托管费                       | -              | -      | -            | -          | -          | 122,828.76     | 122,828.76     |
| 应付交易费用                      | -              | -      | -            | -          | -          | 1,042,915.47   | 1,042,915.47   |
| 其他负债                        | -              | -      | -            | -          | -          | 85,622.55      | 85,622.55      |
| 负债总计                        | -              | -      | -            | -          | -          | 2,579,951.82   | 2,579,951.82   |
| 利率敏感度缺口                     | 129,963,284.02 | -      | 4,207,001.40 | -          | -          | 500,884,419.13 | 635,054,704.55 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月<br>31 日 | 1 个月以内         | 1-3 个月 | 3 个月-1 年     | 1-5 年      | 5 年以上      | 不计息            | 合计             |
| 资产                          |                |        |              |            |            |                |                |
| 银行存款                        | 27,183,354.57  | -      | -            | -          | -          | -              | 27,183,354.57  |
| 结算备付金                       | 2,406,641.06   | -      | -            | -          | -          | -              | 2,406,641.06   |
| 存出保证金                       | 411,803.80     | -      | -            | -          | -          | -              | 411,803.80     |
| 交易性金融资产                     | 26,581,341.60  | -      | 1,660,838.10 | 678,737.90 | 135,955.42 | 509,853,980.46 | 538,910,853.48 |
| 应收证券清算款                     | -              | -      | -            | -          | -          | 886,292.40     | 886,292.40     |

|         |               |   |              |            |            |                |                |
|---------|---------------|---|--------------|------------|------------|----------------|----------------|
| 应收利息    | -             | - | -            | -          | -          | 611,358.17     | 611,358.17     |
| 应收申购款   | -             | - | -            | -          | -          | 546,452.06     | 546,452.06     |
| 资产总计    | 56,583,141.03 | - | 1,660,838.10 | 678,737.90 | 135,955.42 | 511,898,083.09 | 570,956,755.54 |
| 负债      | -             | - | -            | -          | -          | -              | -              |
| 应付证券清算款 | -             | - | -            | -          | -          | 9,813,803.47   | 9,813,803.47   |
| 应付赎回款   | -             | - | -            | -          | -          | 216,718.61     | 216,718.61     |
| 应付管理人报酬 | -             | - | -            | -          | -          | 664,303.38     | 664,303.38     |
| 应付托管费   | -             | - | -            | -          | -          | 110,717.21     | 110,717.21     |
| 应付交易费用  | -             | - | -            | -          | -          | 1,662,534.87   | 1,662,534.87   |
| 应交税费    | -             | - | -            | -          | -          | 2.43           | 2.43           |
| 其他负债    | -             | - | -            | -          | -          | 170,364.74     | 170,364.74     |
| 负债总计    | -             | - | -            | -          | -          | 12,638,444.71  | 12,638,444.71  |
| 利率敏感度缺口 | 56,583,141.03 | - | 1,660,838.10 | 678,737.90 | 135,955.42 | 499,259,638.38 | 558,318,310.83 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                  |                             |                        |
|----|----------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；         |                             |                        |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； |                             |                        |
|    | 此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。  |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动                        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                  | 本期末（2021 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | +25 个基点                          | -7,303.25                   | -3,740.41              |
|    | -25 个基点                          | 7,303.25                    | 3,740.41               |

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控

制其他价格风险。

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 497,189,347.50         | 78.29         | 509,853,980.46           | 91.32         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 34,424,001.40          | 5.42          | 29,056,873.02            | 5.20          |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                      | —             | —                        | —             |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                      | —             | —                        | —             |
| 其他            | —                      | —             | —                        | —             |
| 合计            | 531,613,348.90         | 83.71         | 538,910,853.48           | 96.52         |

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                                                  |                             |                        |
|----|--------------------------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；                        |                             |                        |
|    | 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；           |                             |                        |
|    | Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                                  | 本期末（2021 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%                                      | 61,919,047.76               | 56,752,625.76          |
|    | 业绩比较基准下降 5%                                      | -61,919,047.76              | -56,752,625.76         |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 497,189,347.50 | 77.97         |
|    | 其中：股票             | 497,189,347.50 | 77.97         |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 34,424,001.40  | 5.40          |
|    | 其中：债券             | 34,424,001.40  | 5.40          |
|    | 资产支持证券            | —              | —             |
| 4  | 贵金属投资             | —              | —             |
| 5  | 金融衍生品投资           | —              | —             |
| 6  | 买入返售金融资产          | —              | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 99,362,000.57  | 15.58         |
| 8  | 其他各项资产            | 6,659,306.90   | 1.04          |
| 9  | 合计                | 637,634,656.37 | 100.00        |

注：由于四舍五入的原因，市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 3,522,356.00   | 0.55          |
| B  | 采矿业              | 2,331,169.85   | 0.37          |
| C  | 制造业              | 356,008,779.18 | 56.06         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00          |
| F  | 批发和零售业           | 28,465.12      | 0.00          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 24,027,490.39  | 3.78          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 5,914,599.20   | 0.93          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 11,240,326.51  | 1.77          |
| J  | 金融业              | 14,260,775.65  | 2.25          |
| K  | 房地产业             | —              | —             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 10,306,634.40  | 1.62          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 36,098,924.05  | 5.68          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 30,335.10      | 0.00          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —             |

|   |           |                |       |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育        | 14,311,648.89  | 2.25  |
| Q | 卫生和社会工作   | 11,238,075.40  | 1.77  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 7,831,376.00   | 1.23  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 497,189,347.50 | 78.29 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 128,050   | 38,144,814.50 | 6.01         |
| 2  | 688198 | 佰仁医疗 | 125,767   | 28,674,876.00 | 4.52         |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 48,200    | 25,777,360.00 | 4.06         |
| 4  | 603259 | 药明康德 | 161,239   | 25,248,415.01 | 3.98         |
| 5  | 601816 | 京沪高铁 | 3,674,371 | 19,437,422.59 | 3.06         |
| 6  | 002241 | 歌尔股份 | 430,949   | 18,418,760.26 | 2.90         |
| 7  | 300760 | 迈瑞医疗 | 35,005    | 16,804,150.25 | 2.65         |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 7,870     | 16,186,229.00 | 2.55         |
| 9  | 002607 | 中公教育 | 690,201   | 14,311,648.89 | 2.25         |
| 10 | 002850 | 科达利  | 161,861   | 14,146,651.40 | 2.23         |
| 11 | 300979 | 华利集团 | 122,942   | 13,989,656.20 | 2.20         |
| 12 | 601012 | 隆基股份 | 153,862   | 13,669,100.08 | 2.15         |
| 13 | 002311 | 海大集团 | 159,271   | 12,996,513.60 | 2.05         |
| 14 | 603501 | 韦尔股份 | 39,950    | 12,863,900.00 | 2.03         |
| 15 | 002594 | 比亚迪  | 49,886    | 12,521,386.00 | 1.97         |
| 16 | 601009 | 南京银行 | 1,139,600 | 11,988,592.00 | 1.89         |
| 17 | 300347 | 泰格医药 | 58,138    | 11,238,075.40 | 1.77         |
| 18 | 688179 | 阿拉丁  | 77,371    | 10,850,509.04 | 1.71         |
| 19 | 601888 | 中国中免 | 34,344    | 10,306,634.40 | 1.62         |
| 20 | 601799 | 星宇股份 | 44,301    | 9,999,621.72  | 1.57         |
| 21 | 605499 | 东鹏饮料 | 39,832    | 9,989,865.60  | 1.57         |
| 22 | 688012 | 中微公司 | 52,585    | 8,724,903.20  | 1.37         |
| 23 | 603345 | 安井食品 | 33,930    | 8,618,898.60  | 1.36         |
| 24 | 300919 | 中伟股份 | 50,331    | 8,203,953.00  | 1.29         |
| 25 | 002756 | 永兴材料 | 136,640   | 8,115,049.60  | 1.28         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 26 | 300413 | 芒果超媒 | 114,160 | 7,831,376.00 | 1.23 |
| 27 | 002920 | 德赛西威 | 62,300  | 6,857,984.00 | 1.08 |
| 28 | 603517 | 绝味食品 | 80,558  | 6,790,233.82 | 1.07 |
| 29 | 300973 | 立高食品 | 41,261  | 6,382,371.43 | 1.01 |
| 30 | 688345 | 博力威  | 86,647  | 6,372,886.85 | 1.00 |
| 31 | 688981 | 中芯国际 | 98,142  | 6,067,138.44 | 0.96 |
| 32 | 600754 | 锦江酒店 | 103,856 | 5,914,599.20 | 0.93 |
| 33 | 300496 | 中科创达 | 37,000  | 5,811,220.00 | 0.92 |
| 34 | 300122 | 智飞生物 | 28,600  | 5,340,478.00 | 0.84 |
| 35 | 603806 | 福斯特  | 49,440  | 5,197,627.20 | 0.82 |
| 36 | 002410 | 广联达  | 71,458  | 4,873,435.60 | 0.77 |
| 37 | 688169 | 石头科技 | 3,837   | 4,838,457.00 | 0.76 |
| 38 | 002928 | 华夏航空 | 303,978 | 4,590,067.80 | 0.72 |
| 39 | 002460 | 赣锋锂业 | 37,700  | 4,565,093.00 | 0.72 |
| 40 | 600309 | 万华化学 | 41,789  | 4,547,478.98 | 0.72 |
| 41 | 002179 | 中航光电 | 48,400  | 3,824,568.00 | 0.60 |
| 42 | 002714 | 牧原股份 | 57,825  | 3,516,916.50 | 0.55 |
| 43 | 300896 | 爱美客  | 4,178   | 3,295,940.64 | 0.52 |
| 44 | 300957 | 贝泰妮  | 11,325  | 3,070,082.40 | 0.48 |
| 45 | 600426 | 华鲁恒升 | 88,088  | 2,726,323.60 | 0.43 |
| 46 | 600176 | 中国巨石 | 155,008 | 2,404,174.08 | 0.38 |
| 47 | 600988 | 赤峰黄金 | 155,515 | 2,331,169.85 | 0.37 |
| 48 | 002142 | 宁波银行 | 57,415  | 2,237,462.55 | 0.35 |
| 49 | 688690 | 纳微科技 | 18,277  | 2,147,547.50 | 0.34 |
| 50 | 688185 | 康希诺  | 2,134   | 1,659,761.18 | 0.26 |
| 51 | 688617 | 惠泰医疗 | 1,673   | 624,430.52   | 0.10 |
| 52 | 688699 | 明微电子 | 1,869   | 533,263.08   | 0.08 |
| 53 | 688626 | 翔宇医疗 | 3,652   | 380,392.32   | 0.06 |
| 54 | 688276 | 百克生物 | 2,221   | 232,272.18   | 0.04 |
| 55 | 688700 | 东威科技 | 3,049   | 162,755.62   | 0.03 |
| 56 | 688628 | 优利德  | 2,789   | 90,977.18    | 0.01 |
| 57 | 688669 | 聚石化学 | 2,681   | 86,837.59    | 0.01 |
| 58 | 688663 | 新风光  | 3,279   | 62,989.59    | 0.01 |
| 59 | 688087 | 英科再生 | 2,469   | 54,219.24    | 0.01 |
| 60 | 301020 | 密封科技 | 4,210   | 44,794.40    | 0.01 |
| 61 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230   | 34,721.10    | 0.01 |
| 62 | 688367 | 工大高科 | 1,717   | 30,802.98    | 0.00 |
| 63 | 300981 | 中红医疗 | 266     | 24,043.74    | 0.00 |
| 64 | 301009 | 可靠股份 | 801     | 22,339.89    | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 65  | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 66  | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 67  | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 68  | 300940 | 南极光  | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 69  | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 70  | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 71  | 301013 | 利和兴  | 471   | 12,768.81 | 0.00 |
| 72  | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 73  | 300997 | 欢乐家  | 928   | 12,110.40 | 0.00 |
| 74  | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 75  | 300876 | 蒙泰高新 | 350   | 11,567.50 | 0.00 |
| 76  | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 77  | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 78  | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 79  | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 80  | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 81  | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 82  | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 83  | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 84  | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 85  | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 86  | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 87  | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |
| 88  | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 89  | 300926 | 博俊科技 | 359   | 7,969.80  | 0.00 |
| 90  | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 91  | 300930 | 屹通新材 | 322   | 7,882.56  | 0.00 |
| 92  | 300985 | 致远新能 | 295   | 7,318.95  | 0.00 |
| 93  | 300971 | 博亚精工 | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 94  | 301004 | 嘉益股份 | 312   | 6,845.28  | 0.00 |
| 95  | 300991 | 创益通  | 254   | 6,733.54  | 0.00 |
| 96  | 300927 | 江天化学 | 217   | 6,531.70  | 0.00 |
| 97  | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 98  | 300963 | 中洲特材 | 283   | 6,364.67  | 0.00 |
| 99  | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |
| 100 | 300943 | 春晖智控 | 255   | 5,867.55  | 0.00 |
| 101 | 300972 | 万辰生物 | 430   | 5,439.50  | 0.00 |
| 102 | 300960 | 通业科技 | 234   | 5,396.04  | 0.00 |
| 103 | 605011 | 杭州热电 | 525   | 4,662.00  | 0.00 |



|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 104 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 105 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 106 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 107 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 108 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600900 | 长江电力 | 72,186,513.71 | 12.93          |
| 2  | 601398 | 工商银行 | 49,938,001.00 | 8.94           |
| 3  | 000568 | 泸州老窖 | 47,536,635.45 | 8.51           |
| 4  | 688012 | 中微公司 | 47,091,923.57 | 8.43           |
| 5  | 002607 | 中公教育 | 40,049,736.12 | 7.17           |
| 6  | 300760 | 迈瑞医疗 | 38,900,210.22 | 6.97           |
| 7  | 601128 | 常熟银行 | 37,249,948.18 | 6.67           |
| 8  | 601012 | 隆基股份 | 32,663,197.35 | 5.85           |
| 9  | 002594 | 比亚迪  | 30,171,564.00 | 5.40           |
| 10 | 603501 | 韦尔股份 | 29,632,006.00 | 5.31           |
| 11 | 300750 | 宁德时代 | 29,615,521.91 | 5.30           |
| 12 | 601816 | 京沪高铁 | 24,390,304.00 | 4.37           |
| 13 | 300413 | 芒果超媒 | 23,715,361.70 | 4.25           |
| 14 | 300347 | 泰格医药 | 23,198,669.00 | 4.16           |
| 15 | 002812 | 恩捷股份 | 22,382,652.00 | 4.01           |
| 16 | 600754 | 锦江酒店 | 21,515,428.63 | 3.85           |
| 17 | 002920 | 德赛西威 | 21,319,023.72 | 3.82           |
| 18 | 002850 | 科达利  | 21,104,837.50 | 3.78           |
| 19 | 600519 | 贵州茅台 | 20,708,147.00 | 3.71           |
| 20 | 600585 | 海螺水泥 | 20,550,843.02 | 3.68           |
| 21 | 601318 | 中国平安 | 20,182,524.89 | 3.61           |
| 22 | 603517 | 绝味食品 | 19,231,596.00 | 3.44           |
| 23 | 603259 | 药明康德 | 18,818,796.64 | 3.37           |
| 24 | 002241 | 歌尔股份 | 17,400,324.76 | 3.12           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 25 | 601009 | 南京银行 | 16,940,252.42 | 3.03 |
| 26 | 600426 | 华鲁恒升 | 16,050,530.94 | 2.87 |
| 27 | 600132 | 重庆啤酒 | 15,906,718.27 | 2.85 |
| 28 | 300896 | 爱美客  | 15,844,739.00 | 2.84 |
| 29 | 002142 | 宁波银行 | 14,751,050.21 | 2.64 |
| 30 | 002493 | 荣盛石化 | 14,678,152.59 | 2.63 |
| 31 | 601888 | 中国中免 | 14,560,890.00 | 2.61 |
| 32 | 002756 | 永兴材料 | 14,402,737.00 | 2.58 |
| 33 | 601021 | 春秋航空 | 14,213,442.36 | 2.55 |
| 34 | 000550 | 江铃汽车 | 13,969,279.09 | 2.50 |
| 35 | 600582 | 天地科技 | 13,933,778.78 | 2.50 |
| 36 | 001965 | 招商公路 | 13,823,307.53 | 2.48 |
| 37 | 688198 | 佰仁医疗 | 13,675,723.55 | 2.45 |
| 38 | 002271 | 东方雨虹 | 13,629,119.96 | 2.44 |
| 39 | 601799 | 星宇股份 | 13,368,543.32 | 2.39 |
| 40 | 002714 | 牧原股份 | 13,268,449.61 | 2.38 |
| 41 | 000001 | 平安银行 | 13,023,559.00 | 2.33 |
| 42 | 688111 | 金山办公 | 12,974,763.01 | 2.32 |
| 43 | 002555 | 三七互娱 | 12,896,704.05 | 2.31 |
| 44 | 300979 | 华利集团 | 12,544,473.70 | 2.25 |
| 45 | 002311 | 海大集团 | 12,231,095.49 | 2.19 |
| 46 | 002460 | 赣锋锂业 | 12,224,174.00 | 2.19 |
| 47 | 603345 | 安井食品 | 12,164,073.28 | 2.18 |
| 48 | 688139 | 海尔生物 | 11,690,297.11 | 2.09 |
| 49 | 002928 | 华夏航空 | 11,248,401.50 | 2.01 |

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600900 | 长江电力 | 72,023,940.21 | 12.90          |
| 2  | 688012 | 中微公司 | 53,201,846.73 | 9.53           |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 50,229,135.81 | 9.00           |
| 4  | 000568 | 泸州老窖 | 48,765,132.76 | 8.73           |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 45,747,709.00 | 8.19           |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 44,392,882.70 | 7.95           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 7  | 601128 | 常熟银行 | 36,699,932.11 | 6.57 |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 34,930,132.77 | 6.26 |
| 9  | 601012 | 隆基股份 | 29,470,872.97 | 5.28 |
| 10 | 002812 | 恩捷股份 | 26,087,684.23 | 4.67 |
| 11 | 300760 | 迈瑞医疗 | 25,775,258.99 | 4.62 |
| 12 | 601601 | 中国太保 | 25,625,715.46 | 4.59 |
| 13 | 300122 | 智飞生物 | 24,071,614.42 | 4.31 |
| 14 | 002920 | 德赛西威 | 23,964,182.32 | 4.29 |
| 15 | 600988 | 赤峰黄金 | 23,031,212.87 | 4.13 |
| 16 | 300413 | 芒果超媒 | 22,094,527.99 | 3.96 |
| 17 | 600438 | 通威股份 | 21,964,889.28 | 3.93 |
| 18 | 002594 | 比亚迪  | 21,566,893.80 | 3.86 |
| 19 | 300395 | 菲利华  | 19,988,571.37 | 3.58 |
| 20 | 600754 | 锦江酒店 | 19,918,819.37 | 3.57 |
| 21 | 600585 | 海螺水泥 | 19,914,828.39 | 3.57 |
| 22 | 002607 | 中公教育 | 17,733,504.52 | 3.18 |
| 23 | 603501 | 韦尔股份 | 17,690,452.95 | 3.17 |
| 24 | 601799 | 星宇股份 | 17,499,148.29 | 3.13 |
| 25 | 002555 | 三七互娱 | 17,445,722.91 | 3.12 |
| 26 | 002460 | 赣锋锂业 | 17,211,095.26 | 3.08 |
| 27 | 002007 | 华兰生物 | 16,702,308.11 | 2.99 |
| 28 | 600426 | 华鲁恒升 | 16,448,118.71 | 2.95 |
| 29 | 300661 | 圣邦股份 | 16,180,408.47 | 2.90 |
| 30 | 000550 | 江铃汽车 | 16,168,696.26 | 2.90 |
| 31 | 000661 | 长春高新 | 15,815,866.38 | 2.83 |
| 32 | 601899 | 紫金矿业 | 15,728,733.59 | 2.82 |
| 33 | 600582 | 天地科技 | 15,620,458.61 | 2.80 |
| 34 | 600309 | 万华化学 | 15,545,756.67 | 2.78 |
| 35 | 002311 | 海大集团 | 15,221,966.40 | 2.73 |
| 36 | 300896 | 爱美客  | 15,155,431.84 | 2.71 |
| 37 | 300347 | 泰格医药 | 14,628,440.14 | 2.62 |
| 38 | 300750 | 宁德时代 | 14,622,983.97 | 2.62 |
| 39 | 603986 | 兆易创新 | 14,618,869.80 | 2.62 |
| 40 | 001965 | 招商公路 | 14,567,775.58 | 2.61 |
| 41 | 002493 | 荣盛石化 | 14,246,616.98 | 2.55 |
| 42 | 600399 | 抚顺特钢 | 14,188,070.01 | 2.54 |
| 43 | 688185 | 康希诺  | 14,115,631.32 | 2.53 |
| 44 | 600176 | 中国巨石 | 14,045,353.17 | 2.52 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 45 | 688139 | 海尔生物 | 13,826,461.36 | 2.48 |
| 46 | 601021 | 春秋航空 | 13,629,499.71 | 2.44 |
| 47 | 002410 | 广联达  | 12,923,350.35 | 2.31 |
| 48 | 002475 | 立讯精密 | 12,852,644.41 | 2.30 |
| 49 | 002847 | 盐津铺子 | 12,534,878.22 | 2.25 |
| 50 | 300699 | 光威复材 | 12,315,513.70 | 2.21 |
| 51 | 603517 | 绝味食品 | 12,218,151.25 | 2.19 |
| 52 | 600132 | 重庆啤酒 | 12,195,521.82 | 2.18 |
| 53 | 002271 | 东方雨虹 | 12,145,572.75 | 2.18 |
| 54 | 600588 | 用友网络 | 11,886,321.46 | 2.13 |
| 55 | 300775 | 三角防务 | 11,668,689.59 | 2.09 |
| 56 | 002508 | 老板电器 | 11,508,254.72 | 2.06 |
| 57 | 688111 | 金山办公 | 11,364,554.30 | 2.04 |
| 58 | 000651 | 格力电器 | 11,364,300.99 | 2.04 |
| 59 | 002142 | 宁波银行 | 11,353,428.46 | 2.03 |
| 60 | 300012 | 华测检测 | 11,348,924.00 | 2.03 |
| 61 | 002318 | 久立特材 | 11,242,101.51 | 2.01 |

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,599,277,944.58 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,697,879,135.76 |

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 34,424,001.40 | 5.42         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |

|    |    |               |      |
|----|----|---------------|------|
| 10 | 合计 | 34,424,001.40 | 5.42 |
|----|----|---------------|------|

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 019640 | 20 国债 10 | 302,170 | 30,217,000.00 | 4.76         |
| 2  | 019645 | 20 国债 15 | 41,940  | 4,207,001.40  | 0.66         |

注：本基金本期末仅持有上述债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 383,263.45   |
| 2  | 应收证券清算款 | 5,433,890.41 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 704,859.35   |
| 5  | 应收申购款   | 137,293.69   |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 6,659,306.90 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末仅持有上述处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1  | 002607 | 中公教育 | 2,713,500.00 | 0.43          | 大宗交易流通受限 |

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构          |            |               |            |
|--------------|---------------|----------------|------------|---------------|------------|
|              |               | 机构投资者          |            | 个人投资者         |            |
|              |               | 持有份额           | 占总份<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 17,185       | 14,893.85     | 224,814,000.84 | 87.83%     | 31,136,814.00 | 12.17%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1,536,892.81 | 0.60%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 50~100            |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 50~100            |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                   |                |
|-----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（ 2017 年 12 月 14 日 ）基金份额总额 | 246,271,371.74 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 256,067,087.29 |
| 本报告期基金总申购份额                       | 79,500,351.99  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 79,616,624.44  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）          | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 255,950,814.84 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。



## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 2021 年 2 月 5 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 2 月 5 日起在投资范围中增加存托凭证，并在投资策略中增加存托凭证相关投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|            |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 华泰证券股份有限公司 | 4      | 844,850,364.76 | 25.68%       | 617,840.10 | 25.68%     | —  |
| 川财证券有限责任公司 | 2      | 605,771,905.36 | 18.41%       | 442,999.57 | 18.41%     | —  |
| 华西证券股份有限公司 | 4      | 532,093,436.54 | 16.17%       | 389,116.82 | 16.17%     | —  |
| 天风证券股份有限公司 | 2      | 290,203,442.69 | 8.82%        | 212,226.83 | 8.82%      | —  |

|              |   |                |       |            |       |             |
|--------------|---|----------------|-------|------------|-------|-------------|
| 西南证券股份有限公司   | 2 | 277,409,615.54 | 8.43% | 202,865.21 | 8.43% | -           |
| 开源证券股份有限公司   | 2 | 152,244,925.55 | 4.63% | 111,337.00 | 4.63% | -           |
| 申港证券股份有限公司   | 2 | 133,824,132.71 | 4.07% | 97,865.71  | 4.07% | -           |
| 国信证券股份有限公司   | 2 | 122,851,539.43 | 3.73% | 89,841.90  | 3.73% | -           |
| 长江证券股份有限公司   | 4 | 80,464,237.24  | 2.45% | 58,916.65  | 2.45% | 新增 1 个交易日单元 |
| 东方证券股份有限公司   | 2 | 73,025,684.46  | 2.22% | 53,402.81  | 2.22% | -           |
| 华龙证券股份有限公司   | 2 | 63,775,291.28  | 1.94% | 46,638.89  | 1.94% | -           |
| 德邦证券股份有限公司   | 2 | 44,071,314.43  | 1.34% | 32,229.31  | 1.34% | 新增 2 个交易日单元 |
| 广发证券股份有限公司   | 2 | 34,863,800.91  | 1.06% | 25,497.12  | 1.06% | 新增 2 个交易日单元 |
| 兴业证券股份有限公司   | 2 | 25,967,938.23  | 0.79% | 18,990.21  | 0.79% | -           |
| 中信建投证券股份有限公司 | 4 | 9,022,375.00   | 0.27% | 6,598.23   | 0.27% | 新增 2 个交易日单元 |
| 东方财富证券股份有限公司 | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 东吴证券股份有限公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 光大证券股份有限公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 国盛证券有限责任公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 华创证券有限责任公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 长城证券股份有限公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 中泰证券股份有限公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 中信证券股份有限公司   | 2 | -              | -     | -          | -     | 新增 2 个交易日单元 |
| 安信证券股        | 2 | -              | -     | -          | -     | -           |

|       |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 份有限公司 |  |  |  |  |  |  |
|-------|--|--|--|--|--|--|

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易          |              | 债券回购交易        |                | 权证交易 |              |
|------------|---------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
|            | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华泰证券股份有限公司 | 12,329,226.28 | 14.15%       | 67,200,000.00 | 46.19%         | —    | —            |
| 川财证券有限责任公司 | 15,232,698.09 | 17.49%       | 20,000,000.00 | 13.75%         | —    | —            |
| 华西证券股份有限公司 | 13,507,822.45 | 15.51%       | 5,900,000.00  | 4.05%          | —    | —            |
| 天风证券股份有限公司 | 28,781,887.30 | 33.04%       | —             | —              | —    | —            |
| 西南证券股份有限公司 | 11,191,960.60 | 12.85%       | 22,400,000.00 | 15.40%         | —    | —            |
| 开源证券股份有限公司 | —             | —            | —             | —              | —    | —            |
| 申港证券股份有限公司 | 1,866,819.60  | 2.14%        | —             | —              | —    | —            |
| 国信证券股份有限公司 | 1,599,075.48  | 1.84%        | 30,000,000.00 | 20.62%         | —    | —            |
| 长江证券股份有限公司 | 132,561.36    | 0.15%        | —             | —              | —    | —            |
| 东方证券股份有限公司 | 1,689,831.00  | 1.94%        | —             | —              | —    | —            |
| 华龙证券股份有限公司 | —             | —            | —             | —              | —    | —            |
| 德邦证券股份有限公司 | —             | —            | —             | —              | —    | —            |
| 广发证券股份有限公司 | —             | —            | —             | —              | —    | —            |
| 兴业证券股      | —             | —            | —             | —              | —    | —            |

|                      |            |       |   |   |   |   |
|----------------------|------------|-------|---|---|---|---|
| 份有限公司                |            |       |   |   |   |   |
| 中信建投证<br>券股份有限<br>公司 | 782,156.40 | 0.90% | - | - | - | - |
| 东方财富证<br>券股份有限<br>公司 | -          | -     | - | - | - | - |
| 东吴证券股<br>份有限公司       | -          | -     | - | - | - | - |
| 光大证券股<br>份有限公司       | -          | -     | - | - | - | - |
| 国盛证券有<br>限责任公司       | -          | -     | - | - | - | - |
| 华创证券有<br>限责任公司       | -          | -     | - | - | - | - |
| 长城证券股<br>份有限公司       | -          | -     | - | - | - | - |
| 中国国际金<br>融股份有限<br>公司 | -          | -     | - | - | - | - |
| 中泰证券股<br>份有限公司       | -          | -     | - | - | - | - |
| 中信证券股<br>份有限公司       | -          | -     | - | - | - | - |
| 安信证券股<br>份有限公司       | -          | -     | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                 | 法定披露方式                         | 法定披露日期          |
|----|------------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|
| 1  | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》             | 四大证券报                          | 2021 年 1 月 20 日 |
| 2  | 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》                 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站        | 2021 年 1 月 20 日 |
| 3  | 《银华基金管理股份有限公司关于增加度小满基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》 | 本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 2 月 3 日  |
| 4  | 《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》                    | 本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 2 月 5 日  |

|    |                                                                                       |                                            |                 |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------|
| 5  | 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）》                                             | 本基金管理人网站，<br>中国证监会基金电子披露网站                 | 2021 年 2 月 5 日  |
| 6  | 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）》                                                     | 本基金管理人网站，<br>中国证监会基金电子披露网站                 | 2021 年 2 月 5 日  |
| 7  | 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2021 年 2 月修订）》                                               | 本基金管理人网站，<br>中国证监会基金电子披露网站                 | 2021 年 2 月 5 日  |
| 8  | 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2021 年 2 月修订）》                                               | 本基金管理人网站，<br>中国证监会基金电子披露网站                 | 2021 年 2 月 5 日  |
| 9  | 《银华基金管理股份有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》                                            | 本基金管理人网站，<br>四大证券报，中国证监会基金电子披露网站           | 2021 年 3 月 26 日 |
| 10 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告》                                                  | 四大证券报                                      | 2021 年 3 月 29 日 |
| 11 | 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告》                                                      | 本基金管理人网站，<br>中国证监会基金电子披露网站                 | 2021 年 3 月 29 日 |
| 12 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为代销机构的公告》                                          | 本基金管理人网站，<br>四大证券报，中国证监会基金电子披露网站           | 2021 年 4 月 20 日 |
| 13 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告》                                              | 四大证券报                                      | 2021 年 4 月 21 日 |
| 14 | 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》                                                  | 本基金管理人网站，<br>中国证监会基金电子披露网站                 | 2021 年 4 月 21 日 |
| 15 | 《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金首笔申购的最低金额、每笔追加申购的最低金额、每笔定期定额投资的最低金额、每笔赎回申请的最低份额及赎回后的最低保有份额的公告》 | 本基金管理人网站，<br>中国证券报、证券时报、证券日报，中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 6 月 9 日  |
| 16 | 《银华基金管理股份有限公司关于增加广发证券股份有限公司为银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告》                               | 本基金管理人网站，<br>证券日报，中国证监会基金电子披露网站            | 2021 年 6 月 15 日 |
| 17 | 《银华基金管理股份有限公司关                                                                        | 本基金管理人网站，                                  | 2021 年 6 月 17 日 |

|  |                                       |                      |  |
|--|---------------------------------------|----------------------|--|
|  | 于增加天津银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》 | 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站 |  |
|--|---------------------------------------|----------------------|--|

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2021 年 2 月 5 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 2 月 5 日起增加侧袋机制，在投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行了修订。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2021 年 8 月 28 日