

# 银华汇盈一年持有期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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
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.....	22
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>23</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
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.....	23
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.....	23
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>24</b>
6.1 资产负债表.....	24
6.2 利润表.....	25
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26

6.4 报表附注.....	27
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>54</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	54
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	59
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.....	60
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.....	60
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.....	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>63</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>64</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
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.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	69
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>73</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.....	73

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>74</b>
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	银华汇盈一年持有期混合	
基金主代码	008833	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 20 日	
基金管理人	银华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	849,644,611.09 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	银华汇盈一年持有期混合 A	银华汇盈一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码:	008833	008834
报告期末下属分级基金的份额总额	705,027,765.10 份	144,616,845.99 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过把握股票市场、债券市场的投资机会，采用较灵活的资产配置策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金将采用定量和定性相结合的分析方法，结合对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的定性分析，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极主动地对股票、债券、金融衍生品和现金等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。</p> <p>本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%；同业存单投资比例为基金资产的 0-20%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+中债综合指数（全价）收益率×85%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金及货币市场基金。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	许俊

	联系电话	(010)58163000	010-66594319
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95566
传真		(010)58163027	(010) 66594942
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100738	100818
法定代表人		王珠林	刘连舸

## 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

基金级别	银华汇盈一年持有期混合 A	银华汇盈一年持有期混合 C
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)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	50,807,227.34	7,817,614.81
本期利润	35,125,425.07	5,317,661.60
加权平均基金份额本期利润	0.0160	0.0146
本期加权平均净值利润率	1.52%	1.40%
本期基金份额净值增长率	2.19%	1.97%
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	44,036,107.31	8,246,032.17
期末可供分配基金份额利润	0.0625	0.0570
期末基金资产净值	750,397,057.60	153,136,664.12
期末基金份额净值	1.0644	1.0589
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	6.44%	5.89%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告中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

银华汇盈一年持有期混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.18%	0.07%	-0.22%	0.11%	0.40%	-0.04%
过去三个月	1.54%	0.07%	0.76%	0.13%	0.78%	-0.06%
过去六个月	2.19%	0.08%	0.93%	0.18%	1.26%	-0.10%
过去一年	5.77%	0.09%	2.76%	0.17%	3.01%	-0.08%
自基金合同生效起至今	6.44%	0.10%	4.45%	0.18%	1.99%	-0.08%



银华汇盈一年持有期混合 C

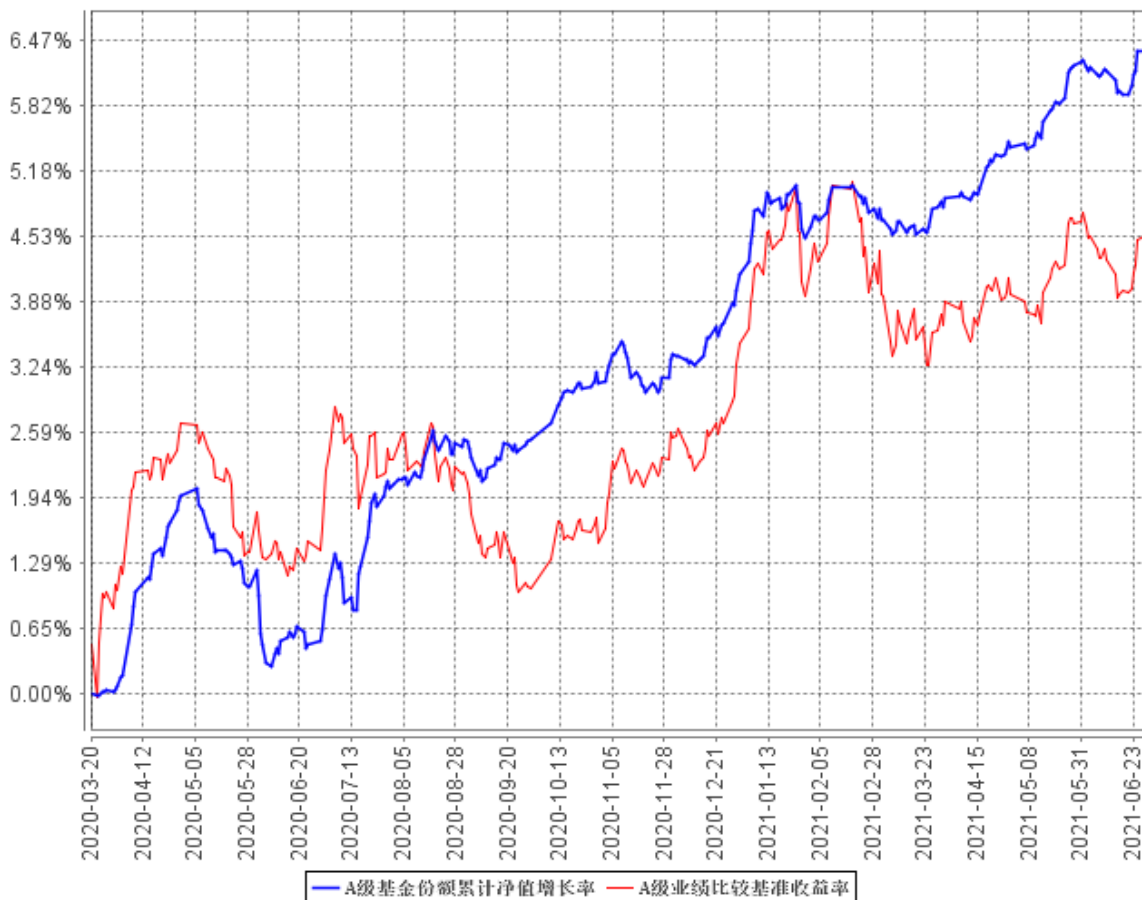
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.14%	0.07%	-0.22%	0.11%	0.36%	-0.04%
过去三个月	1.43%	0.07%	0.76%	0.13%	0.67%	-0.06%
过去六个月	1.97%	0.08%	0.93%	0.18%	1.04%	-0.10%
过去一年	5.35%	0.09%	2.76%	0.17%	2.59%	-0.08%
自基金合同生效起至今	5.89%	0.10%	4.45%	0.18%	1.44%	-0.08%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合指数(全价)收益率\*85%+沪深 300 指数收益率\*10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)\*5%。

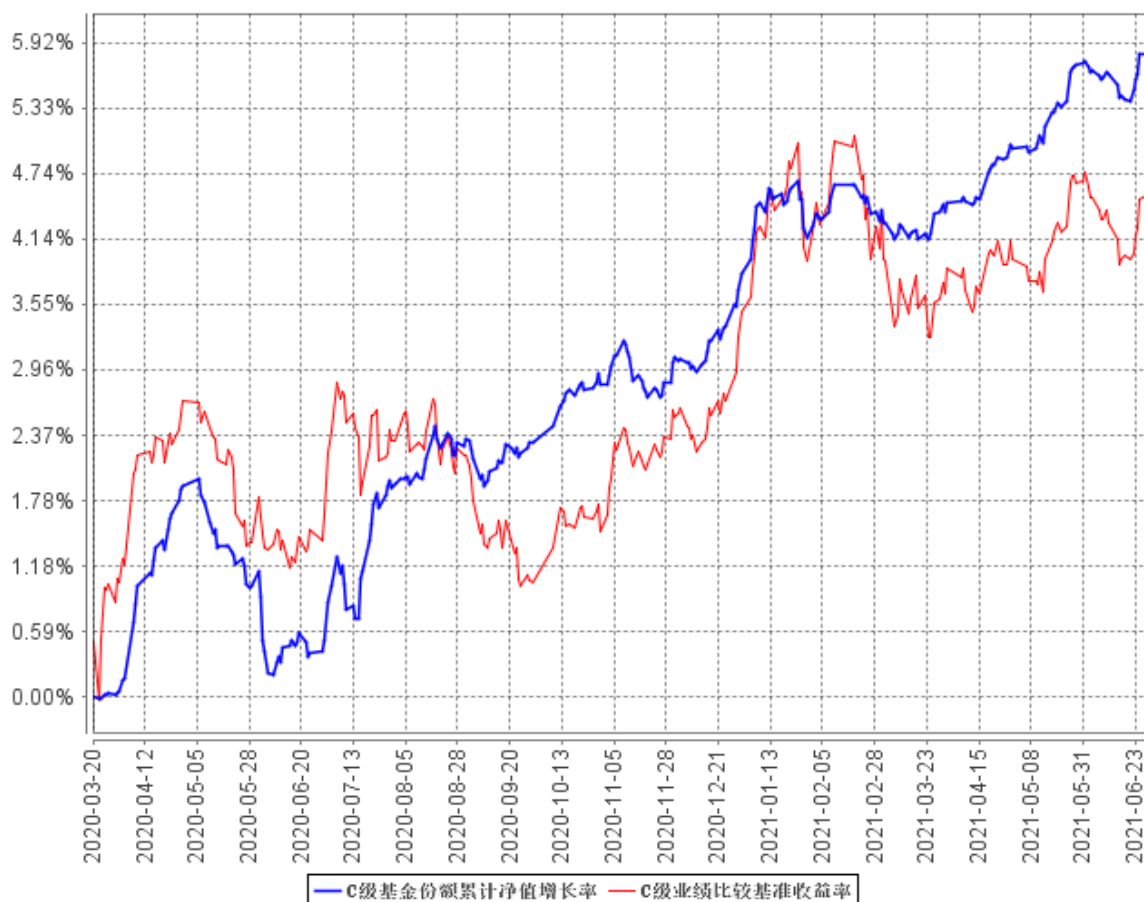
沪深 300 指数选样科学客观，行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。恒生指数作为香港蓝筹股指数，是反映香港股市走势最具影响力的股价指数。中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，能够综合反映债券市场整体价格和回报情况。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

### 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

A级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



C级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：股票投资比例为基金资产的 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%；同业存单投资比例为基金资产的 0-20%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

## § 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、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊享养老目标日期 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）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
边慧女士	本基金的基金经理	2021 年 3 月 26 日	-	9.5 年	硕士学位。曾就职于中国中投证券有限责任公司，2016 年 12 月加入银华基

					金，曾任投资管理三部基金经理助理。现任投资管理三部基金经理兼基金经理助理。自 2021 年 3 月 26 日起担任银华汇盈一年持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。
李丹女士	本基金的基金经理	2021 年 5 月 27 日	-	7.5 年	硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司。2015 年 4 月加入银华基金，历任投资管理三部固收研究部宏观利率研究员、投资管理三部基金经理助理，现任投资管理三部基金经理兼基金经理助理。自 2020 年 10 月 20 日起担任银华岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 23 日起兼任银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 3 月 24 日起兼任银华信用季季红债券型证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金及银华添泽定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 27 日起兼任银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 23 日起兼任银华华茂定期开放债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
邹维娜女士	本基金的基金经理	2020 年 3 月 20 日	2021 年 6 月 4 日	12.5 年	硕士学位。历任国家信息中心下属中经网公司宏观经济分析人员；中再资产管理股份有限公司固定收益部投资经理助理、自有账户投资经理。2012 年 10

				<p>月加入银华基金管理有限公司，曾担任基金经理助理职务，自 2013 年 8 月 7 日至 2021 年 6 月 4 日担任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理，自 2013 年 9 月 18 日至 2021 年 6 月 4 日兼任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理，2014 年 1 月 22 日至 2018 年 9 月 6 日兼任银华永利债券型证券投资基金基金经理，2014 年 5 月 22 日至 2017 年 7 月 13 日兼任银华永益分级债券型证券投资基金基金经理，自 2014 年 10 月 8 日至 2021 年 6 月 4 日兼任银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理，自 2016 年 3 月 22 日至 2021 年 6 月 4 日兼任银华添益定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 11 月 11 日至 2021 年 6 月 4 日兼任银华添泽定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 7 日至 2021 年 6 月 4 日兼任银华添润定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 7 月 25 日至 2021 年 6 月 4 日兼任银华岁盈定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日至 2021 年 6 月 4 日兼任银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 12 月 17 日至 2021 年 6 月 4 日兼任银华招利一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国</p>
--	--	--	--	--



					籍:中国。
龚美若女士	本基金的基金经理助理	2020年3月20日	-	9.5年	硕士学位,曾就职于西南证券股份有限公司、威海市商业银行股份有限公司。2019年2月加入银华基金,现任投资管理三部基金经理兼基金经理助理。自2021年7月22日起担任银华安丰中短期政策性金融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、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
魏晟峻先生	本基金的基金经理助理	2020年3月20日	-	7.5年	硕士学位,曾就职于信达创新有限公司,2016年5月加入银华基金,历任投资管理三部固收交易部助理询价交易员,现任投资管理三部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。
赵楠楠女士	本基金的基金经理助理	2020年4月9日	-	10.5年	硕士学位。曾就职于世德贝投资咨询(北京)有限公司、大公国际资信评估有限公司、中融基金管理有限公司。2017年1月加入银华基金,现任投资管理三部基金经理兼基金经理助理。自2019年7月30日起担任银华安盈短债债券型证券投资基金基金经理,自2019年9月6日至2020年5月30日兼任银华稳裕六个月定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2019年9月6日起兼任银华泰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2020年1月17日起兼任银华安鑫短

					债债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 7 月 16 日起兼任银华通利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 8 月 24 日起兼任银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 8 月 25 日起兼任银华汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 12 月 15 日起兼任银华安颐中短债双月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。
杨沐阳先生	本基金的基金经理助理	2020 年 8 月 12 日	-	4 年	硕士学位。曾就职于中国工商银行股份有限公司，2017 年 10 月加入银华基金，历任投资管理三部固收研究部宏观利率研究员，现任投资管理三部基金经理助理。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。

3、自 2021 年 7 月 14 日起陈皓原女士开始担任本基金基金经理助理职务。

4、自 2021 年 7 月 22 日起龚美若女士不再担任本基金基金经理助理职务。

#### 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、《银华汇盈一年持有期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，经济呈现为不均衡的修复状态。观察相对 2019 年同期的两年平均增速，2021 年一季度和二季度的 GDP 两年平均增速分别为 5% 和 5.5%，其中第二产业增速高于整体 GDP 增速和疫情前水平，第三产业仍是拖累因素。从需求端来看，地产、出口偏强而制造业投资、消费偏弱的格局依然存在。上半年固定资产投资两年平均增速为 4.5%，高于 2020 年全年增速的 2.9%，稍低于疫情前 2019 年全年增速的 5.4%；其中，上半年的地产投资、基建投资、制造业投资两年平均增速分别为 8.3%、3.5%、2.6%，地产投资增速维持高位，基建投资增速较为平稳，制造业投资增速年初以来逐渐改善但绝对水平仍不高。上半年社会零售总额两年平均增速为 4.4%，高于 2020 年全年增速的 -3.9%，但较 2019 年全年增速的 8% 仍有较明显距离，消费修复进程整体上慢于预期，或与居民收入恢复较慢且结构分化有关，局部疫情反复也构成拖累。上半年美元计价的出口金额两年平均增速为 13.8%，明显高于 2020 年的 3.6% 和 2019 年的 0.5%，维持强劲表现。就业方面，城镇调查失业率由去年 12 月的 5.2% 下降至今年 6 月的 5.0%，就业形势继续改善。物价方面，上半年 CPI 累计同比 0.5%，核心 CPI 累计同比 0.4%，PPI 累计同比 5.1%，物价表现分化明显。总的

来看，年初国内疫情反复和“就地过年”等管控措施对经济产生了较为显著的影响，令一季度经济恢复程度较去年四季度回落，在国内疫情得到控制后又逐渐有所复苏，但结构表现不均衡的现象仍然凸显，经济动能并非十分强劲。物价呈现出与经济增长相对应的分化格局，PPI 涨幅较大，但 CPI 表现温和，目前尚不存在全局性的通胀压力。

2021 年上半年，债券收益率震荡下行，节奏来看先上后下，受流动性预期影响较大。2021 年 1 月末，资金面超预期大幅收紧，市场对货币政策预期更加谨慎，引发债券收益率上行。3-5 月间资金面持续平稳偏松，货币政策执行报告显示央行认为通胀风险可控等政策信号也增强了市场对资金面的信心，债券收益率逐步回落。进入 6 月，资金面宽松程度有所收敛，收益率出现回升。6 月 20 日央行主管媒体发文称“市场主体无需对流动性产生不必要的担忧”，市场对于资金面稳定的信心增强，收益率再度下行。上半年各债券品种收益率均有不同程度下行，利率债方面，短端的 1 年国债收益率较去年末下行 4bp 至 2.43%，1 年国开债收益率下行 4bp 至 2.51%；长端的 10 年国债收益率下行 7bp 至 3.08%，10 年国开债收益率下行 5bp 至 3.49%；信用债方面，1、3、5 年 AAA 中票收益率分别下行 17bp、14bp、9bp，1、3、5 年 AA+中票收益率分别下行 36bp、42bp、44bp，1、3、5 年 AA 中票收益率分别下行 53bp、38bp、29bp，信用债表现好于利率债，信用利差明显压缩。

权益市场方面，上半年呈现宽幅波动走势。一季度，A 股在春节后出现快速回调，部分估值较高的前期热门板块调整尤为剧烈。二季度，国内政策信号较为平稳，同时国内银行间流动性平稳偏松，海外美债收益率也出现明显下行，流动性环境好于预期，A 股表现回暖，成长风格表现好于价值风格。上半年来看，上证综指上涨 3.4%，沪深 300 上涨 0.2%，创业板指和中小板指分别上涨 17.2%和 3.7%。

上半年，本基金根据市场变化做出了调整，根据不同品种的表现优化了持仓结构。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华汇盈一年持有期混合 A 基金份额净值为 1.0644 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.19%；截至本报告期末银华汇盈一年持有期混合 C 基金份额净值为 1.0589 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.97%；同期业绩比较基准收益率为 0.93%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为经济不均衡状态仍有望延续，经济动能大概率在二季度跨过高点，但暂时还未体现出明显的下行压力。今年上半年国内政策重心由稳增长向防风险、调结构倾斜，体现在持续抑制地产杠杆、防控隐性债务、压降非标融资等方面，信用环境较去年有所收紧，对经济的支撑力度边际弱化。货币政策方面，或延续二季度以来的中性偏温和态度，但也缺乏进一步放

松诉求。今年 2 月以来资金面维持平稳，一定程度上与地方债发行放缓、央行缺乏流动性回笼工具等因素有关，但也与基本面环境大体匹配，显示当前融资需求并不强劲。目前经济处于复苏进程但结构不均衡、绝对水平不强，经济结构的分化也造成了物价的分化，体现为 PPI 高企而 CPI 不强。考虑到基数因素和工业品供求环境，二季度或是 PPI 读数高点，但供需错配的格局尚未根本缓解，下半年 PPI 中枢仍有不确定性。在经济动能可能逐渐跨过高点但韧性仍较强，物价结构性上涨但没有全局性通胀压力的背景下，短期内货币政策大幅收紧或放松的迫切性可能都不强。2021 年 7 月 7 日国务院常务会议部署降准并随后落地，可能与高层关注中小微企业经营压力和就业压力有关。对于债券市场而言，资金面的影响更为直接。近年来央行加强了政策利率对资金利率的指示意义，并多次强调市场应重点关注政策利率而不应过度关注操作数量，而 2021 年 7 月 15 日 MLF 和逆回购利率维持不变，可能意味着货币政策仍是偏中性态度。下半年，我们仍倾向于认为地产和城投面临的融资政策难以转松，“稳货币、偏紧信用”的格局仍会继续演绎。后续随着 MLF 到期量增大，“结构性流动性短缺的货币政策操作框架”下的央行贷方地位增强，资金面对央行操作的依赖度将有所上升，资金利率或回归围绕政策利率波动的状态，而市场流动性环境仍有望维持相对充裕的状态。

结合我们对于下半年经济整体走势和政策基调的判断，我们依然认为下半年债券市场存在投资机会。但在货币政策中性环境下，操作上仍需要采取逆向思维，对市场一致预期保持一份警惕。后续本基金在债券部分的投资上，仍将维持适度杠杆水平，采取中性久期，在严格控制信用风险的前提下，对组合配置进行优化调整。此外，我们以增厚策略看待转债资产，将在估值合理时适度择机参与投资。

权益市场方面，从资产比价角度看，随着盈利增长在一定程度上消化估值，当前权益性价比较年初有所改善。展望下半年，在经济没有失速风险、流动性环境中性的背景下，股市可能会延续震荡走势，内部仍是结构分化行情。本基金将更加重视安全边际，在权益资产性价比弱化时适度控制权益仓位，等待投资机会。在股票投资风格上，我们认为高增长的大赛道依然是稀缺的，因此在仓位适中的情况下，仍会保持适度积极的配置结构。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：银华汇盈一年持有期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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,518,207.34	1,009,782.42
结算备付金		54,664,517.70	57,874,727.85
存出保证金		154,856.08	145,293.79
交易性金融资产	6.4.7.2	987,578,483.27	4,313,558,433.79
其中：股票投资		65,121,483.27	279,724,906.07
基金投资		-	-
债券投资		922,457,000.00	4,033,833,527.72
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	19,000,129.50	-
应收证券清算款		16,000.14	10,418.64
应收利息	6.4.7.5	9,939,530.15	64,797,379.63
应收股利		-	-
应收申购款		102,900.62	66,848.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,084,974,624.80	4,437,462,884.30
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		163,800,000.00	-
应付证券清算款		5,871,552.73	-
应付赎回款		10,737,478.90	-
应付管理人报酬		643,477.69	2,982,562.46
应付托管费		120,652.07	559,230.46
应付销售服务费		53,835.92	201,196.98
应付交易费用	6.4.7.7	45,908.68	99,826.54
应交税费		53,689.98	400,367.72



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	114,307.11	110,000.00
负债合计		181,440,903.08	4,353,184.16
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	849,644,611.09	4,257,785,396.28
未分配利润	6.4.7.10	53,889,110.63	175,324,303.86
所有者权益合计		903,533,721.72	4,433,109,700.14
负债和所有者权益总计		1,084,974,624.80	4,437,462,884.30

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，银华汇盈一年持有期混合 A 基金份额净值 1.0644 元，基金份额总额 705,027,765.10 份；银华汇盈一年持有期混合 C 基金份额净值 1.0589 元，基金份额总额 144,616,845.99 份。银华汇盈一年持有期混合份额总额合计为 849,644,611.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华汇盈一年持有期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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日(基金 合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		55,444,603.38	39,042,801.98
1.利息收入		46,439,986.96	38,715,706.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	633,427.32	826,835.52
债券利息收入		44,804,987.56	36,357,762.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,001,572.08	1,531,108.44
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		27,186,371.90	8,831,403.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	79,072,470.08	2,996,915.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-52,156,994.92	2,447,837.09
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	-	-442,450.00
股利收益	6.4.7.16	270,896.74	3,829,101.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-18,181,755.48	-8,504,313.06
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	-	4.99
<b>减：二、费用</b>		15,001,516.71	13,634,015.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,784,378.76	9,360,088.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,022,071.01	1,755,016.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	761,473.70	615,461.61
4. 交易费用	6.4.7.19	652,590.50	435,781.21
5. 利息支出		486,431.11	1,298,645.53
其中：卖出回购金融资产支出		486,431.11	1,298,645.53
6. 税金及附加		136,025.74	117,596.11
7. 其他费用	6.4.7.20	158,545.89	51,426.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		40,443,086.67	25,408,786.18
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		40,443,086.67	25,408,786.18

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华汇盈一年持有期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 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）	4,257,785,396.28	175,324,303.86	4,433,109,700.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,443,086.67	40,443,086.67
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）	-3,408,140,785.19	-161,878,279.90	-3,570,019,065.09
其中：1.基金申购款	14,763,349.20	720,235.84	15,483,585.04
2.基金赎回款	-3,422,904,134.39	-162,598,515.74	-3,585,502,650.13
四、本期向基金份额持	-	-	-



存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,153,807,126.40 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0149 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,154,538,693.16 份基金份额，其中认购资金利息折合 731,566.76 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、政策性金融债券、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券及其他经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、金融衍生工具(包括股指期货、股票期权和国债期货)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相关规定)。本基金的股票投资比例为基金资产的 0-40%，其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%；同业存单投资比例为基金资产的 0-20%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×5%+中债综合指数(全价)收益率×85%。

#### 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 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	13,518,207.34
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：	13,518,207.34

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	51,740,507.86	65,121,483.27	13,380,975.41
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	438,483,075.43	435,196,000.00	-3,287,075.43
	银行间市场	486,920,480.22	487,261,000.00	340,519.78
	合计	925,403,555.65	922,457,000.00	-2,946,555.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		977,144,063.51	987,578,483.27	10,434,419.76

### 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

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	19,000,129.50	-
合计	19,000,129.50	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	360.03
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	29,551.30
应收债券利息	9,904,473.14
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	5,075.98
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	69.70
合计	9,939,530.15

#### 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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	36,967.30
银行间市场应付交易费用	8,941.38
合计	45,908.68

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	251.77
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,055.34
合计	114,307.11

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银华汇盈一年持有期混合 A		
项目	本期 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	3,681,155,657.22	3,681,155,657.22
本期申购	10,755,766.13	10,755,766.13
本期赎回(以“-”号填列)	-2,986,883,658.25	-2,986,883,658.25
- 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	705,027,765.10	705,027,765.10

金额单位：人民币元

银华汇盈一年持有期混合 C		
项目	本期 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	576,629,739.06	576,629,739.06
本期申购	4,007,583.07	4,007,583.07
本期赎回(以“-”号填列)	-436,020,476.14	-436,020,476.14
- 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	144,616,845.99	144,616,845.99

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

银华汇盈一年持有期混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	128,523,200.03	24,677,350.19	153,200,550.22
本期利润	50,807,227.34	-15,681,802.27	35,125,425.07
本期基金份额交易产生的变动数	-135,294,320.06	-7,662,362.73	-142,956,682.79
其中：基金申购款	504,747.44	32,110.75	536,858.19
基金赎回款	-135,799,067.50	-7,694,473.48	-143,493,540.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,036,107.31	1,333,185.19	45,369,292.50

单位：人民币元

银华汇盈一年持有期混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,268,325.59	3,855,428.05	22,123,753.64
本期利润	7,817,614.81	-2,499,953.21	5,317,661.60
本期基金份额交易产生的变动数	-17,839,908.23	-1,081,688.88	-18,921,597.11
其中：基金申购款	163,801.35	19,576.30	183,377.65
基金赎回款	-18,003,709.58	-1,101,265.18	-19,104,974.76

本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,246,032.17	273,785.96	8,519,818.13

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	62,516.05	
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	569,831.17	
其他	1,080.10	
合计	633,427.32	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	79,072,470.08	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	79,072,470.08	

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	273,834,741.81	
减：卖出股票成本总额	194,762,271.73	
买卖股票差价收入	79,072,470.08	

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

**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 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	-52,156,994.92
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	-52,156,994.92

**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 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	5,388,995,393.71
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,361,502,649.41
减：应收利息总额	79,649,739.22
买卖债券差价收入	-52,156,994.92

**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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	270,896.74
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	270,896.74

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-18,181,755.48
——股票投资	-60,288,614.78
——债券投资	42,106,859.30
——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 增值税	-
合计	-18,181,755.48

#### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	617,640.50
银行间市场交易费用	34,950.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	652,590.50

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	26,340.55
账户服务费	18,150.00
合计	158,545.89

#### 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
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月20日(基金合同生效日)至 2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
西南证券	306,540,326.61	100.00%	337,693,852.43	100.00%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月20日(基金合同生效日)至 2020年6月30日	
	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 成交总额的比例
西南证券	1,331,154,740.99	100.00%	1,408,332,071.78	100.00%

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月20日(基金合同生效日)至 2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比例
西南证券	14,770,800,000.00	100.00%	28,918,700,000.00	100.00%

#### 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 2021年1月1日至2021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	285,480.66	100.00%	36,967.30	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年3月20日(基金合同生效日)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	314,493.48	100.00%	203,735.28	100.00%

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年3月20日(基金合同生效日)至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	10,784,378.76
其中：支付销售机构的客户维护费	5,170,680.27	5,153,753.33

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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，自动在次月初五个工作日内、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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,022,071.01	1,755,016.61

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，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，自动在次月初五个工作日内、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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华汇盈一年持有期混合 A	银华汇盈一年持有期混合 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	897.18	897.18
中国银行	-	115,850.79	115,850.79
合计	-	116,747.97	116,747.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华汇盈一年持有期混合 A	银华汇盈一年持有期混合 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	782.26	782.26
中国银行	-	59,271.69	59,271.69
合计	-	60,053.95	60,053.95

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：



$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，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，自动在次月初五个工作日内、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。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

销售服务费不包括基金募集期间的上述费用。

#### 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

注：无。

#### 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

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 3 月 20 日(基金合同生效日)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
中国银行	13,518,207.34	62,516.05	25,030,172.89	626,877.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按同业利率或约定利率计息。

#### 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										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688626	翔宇医疗	2021 年 3 月 23 日	2021 年 10 月 8 日	新发流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	
688606	奥泰生物	2021 年 3 月 17 日	2021 年 9 月 27 日	新发流通受限	133.67	139.31	2,703	361,310.01	376,554.93	
688317	之江生物	2021 年 1 月 8 日	2021 年 7 月 19 日	新发流通受限	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80	
688076	诺泰生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新发流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	
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	853	40,372.49	214,921.88	
688661	和林微纳	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 29 日	新发流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	
688314	康拓医疗	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 18 日	新发流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	
688350	富淼科技	2021 年 1 月 21 日	2021 年 7 月 28 日	新发流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	
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	

688092	爱科科技	2021年3月12日	2021年9月18日	新发流通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新发流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新发流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新发流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新发流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新发流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新发流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新发流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新发流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

		日	7 日							
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新发流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新发流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新发流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新发流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新发流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新发流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-

#### 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

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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约责任，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同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 202 1 年 6 月 30 日 资	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

产							
银行存款	13,518,207.34	-	-	-	-	-	13,518,207.34
结算备付金	54,664,517.70	-	-	-	-	-	54,664,517.70
存出保证金	154,856.08	-	-	-	-	-	154,856.08
交易性金融资产	20,134,000.00	-396,989,000.00	484,275,200.00	21,058,800.00	65,121,483.27		987,578,483.27
买入返售金融资产	19,000,129.50	-	-	-	-	-	19,000,129.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	16,000.14	16,000.14
应收利息	-	-	-	-	-	9,939,530.15	9,939,530.15
应收申	-	-	-	-	-	102,900.62	102,900.62

购款							
资产总计	107,471,710.62	-396,989,000.00	484,275,200.00	21,058,800.00	75,179,914.18	1,084,974,624.80	
负债							
卖出回购金融资产款	163,800,000.00	-	-	-	-	-	163,800,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,871,552.73	5,871,552.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	10,737,478.90	10,737,478.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	643,477.69	643,477.69
应付托管费	-	-	-	-	-	120,652.07	120,652.07
应付销	-	-	-	-	-	53,835.92	53,835.92



售 服 务 费							
应 付 交 易 费 用						45,908.68	45,908.68
应 交 税 费						53,689.98	53,689.98
其 他 负 债						114,307.11	114,307.11
负 债 总 计	163,800,000.00					17,640,903.08	181,440,903.08
利 率 敏 感 度 缺 口	-56,328,289.38		-396,989,000.00	484,275,200.00	21,058,800.00	57,539,011.10	903,533,721.72
上 年 度 末 202 0 年 12 月 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	1,009,782.42						1,009,782.42

款							
结算备付金	57,874,727.85	-	-	-	-	-	57,874,727.85
存出保证金	145,293.79	-	-	-	-	-	145,293.79
交易性金融资产	200,185,000.00	301,371,708.80	1,033,561,000.00	2,466,448,918.60	32,266,900.32	279,724,906.07	4,313,558,433.79
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,418.64	10,418.64
应收利息	-	-	-	-	-	64,797,379.63	64,797,379.63
应收申购款	10.00	-	-	-	-	66,838.18	66,848.18
资产总计	259,214,814.06	301,371,708.80	1,033,561,000.00	2,466,448,918.60	32,266,900.32	344,599,542.52	4,437,462,884.30
负债							
应付管理	-	-	-	-	-	2,982,562.46	2,982,562.46

人 报 酬							
应付 托 管 费	-	-	-	-	-	559,230.46	559,230.46
应付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	201,196.98	201,196.98
应付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	99,826.54	99,826.54
应 交 税 费	-	-	-	-	-	400,367.72	400,367.72
其 他 负 债	-	-	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负 债 总 计	-	-	-	-	-	4,353,184.16	4,353,184.16
利 率 敏 感 度 缺 口	259,214,814. 06	301,371,708. 80	1,033,561,000. 00	2,466,448,918. 60	32,266,900. 32	340,246,358. 36	4,433,109,700. 14

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

**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	-3,378,682.52	-16,906,906.27
	-25 个基点	3,378,682.52	16,906,906.27

**6.4.13.4.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

**6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析**

注：本基金于本报告期末未持有或持有的以非记账本位币人民币计价的资产占比并不重大，因此外汇汇率的变动对本基金资产净值无重大影响。

**6.4.13.4.3 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。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	65,121,483.27	7.21	279,724,906.07	6.31
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	922,457,000.00	102.09	4,033,833,527.72	90.99
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	987,578,483.27	109.30	4,313,558,433.79	97.30

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金主要投资于固定收益类品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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	65,121,483.27	6.00
	其中：股票	65,121,483.27	6.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	922,457,000.00	85.02
	其中：债券	922,457,000.00	85.02
	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	19,000,129.50	1.75
	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	68,182,725.04	6.28
8	其他各项资产	10,213,286.99	0.94
9	合计	1,084,974,624.80	100.00

### 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	5,850.78	0.00
B	采矿业	2,660,968.00	0.29
C	制造业	36,433,939.91	4.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,358,892.87	0.15
E	建筑业	1,001,464.44	0.11
F	批发和零售业	235,377.36	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,406,612.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,045,733.15	0.23
J	金融业	16,518,444.10	1.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,523,307.60	0.17
M	科学研究和技术服务业	1,913,842.98	0.21

N	水利、环境和公共设施管理业	17,050.08	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	65,121,483.27	7.21

### 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	600519	贵州茅台	2,500	5,141,750.00	0.57
2	600036	招商银行	78,700	4,264,753.00	0.47
3	601012	隆基股份	41,811	3,714,489.24	0.41
4	601318	中国平安	43,500	2,796,180.00	0.31
5	600690	海尔智家	92,000	2,383,720.00	0.26
6	600030	中信证券	83,800	2,089,972.00	0.23
7	600570	恒生电子	21,807	2,033,502.75	0.23
8	600809	山西汾酒	4,511	2,020,928.00	0.22
9	603259	药明康德	12,222	1,913,842.98	0.21
10	601166	兴业银行	89,500	1,839,225.00	0.20
11	600276	恒瑞医药	26,640	1,810,720.80	0.20
12	600309	万华化学	14,800	1,610,536.00	0.18
13	601888	中国中免	5,076	1,523,307.60	0.17
14	600031	三一重工	51,500	1,497,105.00	0.17
15	600900	长江电力	65,207	1,345,872.48	0.15
16	601398	工商银行	245,500	1,269,235.00	0.14
17	600887	伊利股份	34,100	1,255,903.00	0.14
18	603345	安井食品	4,400	1,117,688.00	0.12
19	603501	韦尔股份	3,400	1,094,800.00	0.12
20	002311	海大集团	13,400	1,093,440.00	0.12
21	600104	上汽集团	46,700	1,025,999.00	0.11
22	600703	三安光电	32,000	1,025,600.00	0.11
23	600585	海螺水泥	24,600	1,009,830.00	0.11

24	601668	中国建筑	213,000	990,450.00	0.11
25	600196	复星医药	13,600	980,968.00	0.11
26	601231	环旭电子	54,000	907,740.00	0.10
27	601601	中国太保	31,200	903,864.00	0.10
28	603658	安图生物	11,050	837,258.50	0.09
29	600988	赤峰黄金	54,600	818,454.00	0.09
30	600745	闻泰科技	8,200	794,580.00	0.09
31	600837	海通证券	66,800	768,200.00	0.09
32	600183	生益科技	30,200	706,982.00	0.08
33	603288	海天味业	5,018	647,071.10	0.07
34	601899	紫金矿业	65,100	630,819.00	0.07
35	601111	中国国航	80,000	622,400.00	0.07
36	600176	中国巨石	38,519	597,429.69	0.07
37	601818	光大银行	154,300	583,254.00	0.06
38	601009	南京银行	54,300	571,236.00	0.06
39	601225	陕西煤业	47,600	564,060.00	0.06
40	600019	宝钢股份	73,400	560,776.00	0.06
41	601688	华泰证券	35,000	553,000.00	0.06
42	600741	华域汽车	20,400	535,908.00	0.06
43	601238	广汽集团	39,800	515,410.00	0.06
44	600377	宁沪高速	51,200	499,712.00	0.06
45	601100	恒立液压	5,300	455,376.00	0.05
46	600926	杭州银行	30,000	442,500.00	0.05
47	601857	中国石油	82,700	437,483.00	0.05
48	603899	晨光文具	5,000	422,800.00	0.05
49	601066	中信建投	12,800	402,304.00	0.04
50	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.04
51	688606	奥泰生物	2,703	376,554.93	0.04
52	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.04
53	601021	春秋航空	5,000	284,500.00	0.03
54	600346	恒力石化	10,300	270,272.00	0.03
55	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.03
56	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.02
57	601933	永辉超市	45,100	213,323.00	0.02
58	600028	中国石化	48,200	210,152.00	0.02
59	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.02
60	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
61	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
62	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01



63	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.01
64	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.01
65	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
66	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
67	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
68	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
69	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
70	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
71	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
72	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
73	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
74	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
75	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
76	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
77	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
78	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
79	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
80	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
81	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
82	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
83	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
84	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
85	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
86	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
87	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
88	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
89	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
90	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	600690	海尔智家	3,010,734.80	0.07
2	300059	东方财富	1,493,284.00	0.03
3	002410	广联达	1,471,859.00	0.03
4	002179	中航光电	1,418,077.00	0.03

5	601398	工商银行	1,319,225.00	0.03
6	000568	泸州老窖	1,187,200.00	0.03
7	688819	天能股份	1,186,083.78	0.03
8	002311	海大集团	1,110,436.00	0.03
9	603345	安井食品	1,105,720.00	0.02
10	002008	大族激光	1,025,637.00	0.02
11	603501	韦尔股份	1,020,000.00	0.02
12	600988	赤峰黄金	1,007,463.00	0.02
13	600183	生益科技	1,002,770.00	0.02
14	600703	三安光电	1,000,000.00	0.02
15	600570	恒生电子	996,966.00	0.02
16	601231	环旭电子	993,425.00	0.02
17	603658	安图生物	983,564.00	0.02
18	600745	闻泰科技	976,322.00	0.02
19	300014	亿纬锂能	952,536.00	0.02
20	300124	汇川技术	935,190.00	0.02

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	601318	中国平安	15,714,818.98	0.35
2	600519	贵州茅台	11,018,910.00	0.25
3	000858	五粮液	9,332,680.73	0.21
4	600036	招商银行	9,172,474.66	0.21
5	000333	美的集团	8,705,396.70	0.20
6	000651	格力电器	8,049,699.46	0.18
7	601012	隆基股份	7,331,828.15	0.17
8	000001	平安银行	6,666,811.19	0.15
9	000338	潍柴动力	5,944,073.45	0.13
10	002415	海康威视	5,388,810.66	0.12
11	600031	三一重工	4,836,163.00	0.11
12	000002	万科 A	4,761,180.52	0.11
13	000725	京东方 A	4,609,407.72	0.10
14	300059	东方财富	4,503,629.79	0.10
15	002142	宁波银行	4,328,991.21	0.10

16	000661	长春高新	4,180,461.68	0.09
17	000568	泸州老窖	4,133,165.49	0.09
18	002475	立讯精密	4,030,846.56	0.09
19	601601	中国太保	3,692,840.97	0.08
20	600030	中信证券	3,643,176.04	0.08

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	40,447,463.71
卖出股票收入（成交）总额	273,834,741.81

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	290,363,000.00	32.14
	其中：政策性金融债	50,075,000.00	5.54
4	企业债券	265,871,000.00	29.43
5	企业短期融资券	50,009,000.00	5.53
6	中期票据	282,485,000.00	31.26
7	可转债（可交换债）	33,729,000.00	3.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	922,457,000.00	102.09

### 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	101801294	18 闽投 MTN003	500,000	50,495,000.00	5.59
2	143616	18 浙能 01	400,000	41,176,000.00	4.56
3	102002050	20 苏国信 MTN008	400,000	40,552,000.00	4.49
4	155352	19 华电 01	400,000	40,304,000.00	4.46
5	102100807	21 光明 MTN001	400,000	40,028,000.00	4.43

**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。

**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。

**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包括 20 海通 06（证券代码：163568）。

根据海通证券 2021 年 3 月 30 日披露的公告，该公司收到上海证监局《关于对海通证券股份有限公司采取责令增加合规检查次数、责令暂停部分业务措施的决定》。

上述处罚信息公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**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	154,856.08
2	应收证券清算款	16,000.14
3	应收股利	-
4	应收利息	9,939,530.15
5	应收申购款	102,900.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	10,213,286.99
---	----	---------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	10,243,000.00	1.13
2	110053	苏银转债	2,427,200.00	0.27

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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，各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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
银华汇盈一年持有期混合 A	9,950	70,857.06	994,275.79	0.14%	704,033,489.31	99.86%
银华汇盈一年持有期混合 C	2,787	51,889.79	-	-	144,616,845.99	100.00%
合计	12,737	66,706.81	994,275.79	0.12%	848,650,335.30	99.88%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	银华汇盈一年持有期混合 A	59,233.77	0.01%
	银华汇盈一年持有期混合 C	510,021.40	0.35%
	合计	569,255.17	0.07%

### 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

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华汇盈一年持有期混合 A	银华汇盈一年持有期混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 20 日）基金份额总额	3,607,593,698.88	546,944,994.28
本报告期期初基金份额总额	3,681,155,657.22	576,629,739.06
本报告期基金总申购份额	10,755,766.13	4,007,583.07
减：本报告期基金总赎回份额	2,986,883,658.25	436,020,476.14
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	705,027,765.10	144,616,845.99

注：本期申购中包含转入份额，本期赎回中包含转出份额。

## § 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 10 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 10 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

本基金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	
西南证券股份有限公司	2	306,540,326.61	100.00%	285,480.66	100.00%	-
新时代证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
川财证券有	2	-	-	-	-	-



限责任公司						
大同证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	3	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国开证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

信达证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
财信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券华南股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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
西南证券股份有限公司	1,331,154,740.99	100.00%	14,770,800,000.00	100.00%	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国开证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 集团股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
山西证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
中天证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
财信证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
粤开证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 华南股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
财达证券 有限责任 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	四大证券报	2021 年 1 月 20 日

	季度报告提示性公告》		
2	《银华汇盈一年持有期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旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	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
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, 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 2 月 10 日
5	《银华汇盈一年持有期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, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 10 日
6	《银华汇盈一年持有期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, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 10 日
7	《银华汇盈一年持有期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, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 10 日
8	《银华汇盈一年持有期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, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 10 日
9	《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金恢复大额申购(含定期定额投资及转换转入)业务的公告》	本基金管理人网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 17 日
10	《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务的公告》	本基金管理人网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 18 日
11	《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
12	《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金 2020 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 29 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	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 3 月 30 日

14	《银华基金管理股份有限公司关于银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
15	《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
16	《银华汇盈一年持有期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, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
17	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京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, 中国证券报, 上海证券报, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 8 日
18	《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
19	《银华汇盈一年持有期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, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
20	《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, 中国证券报, 上海证券报, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 23 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	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 4 月 27 日
22	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	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 5 月 17 日
23	《银华基金管理股份有限公司关于银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 29 日
24	《银华汇盈一年持有期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, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 31 日
25	《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金更新招募说	本基金管理人网站, 中国证监会基金电	2021 年 5 月 31 日

	说明书（2021 年第 3 号）》	子披露网站	
26	《银华基金管理股份有限公司关于增加浙江同花顺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 6 月 4 日
27	《银华基金管理股份有限公司关于银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金经理离任的公告》	本基金管理人网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 5 日
28	《银华汇盈一年持有期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, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 7 日
29	《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 4 号）》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 7 日
30	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京汇成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 6 月 7 日
31	《银华基金管理股份有限公司关于调整银华汇盈一年持有期混合型证券投资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, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 10 日
32	《银华基金管理股份有限公司关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》	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 6 月 17 日
33	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资（如有）业务的公告》	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 6 月 28 日



## § 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

1、本基金管理人于 2021 年 2 月 10 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 10 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。

2、本基金管理人于 2021 年 3 月 18 日披露了《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金开放日常赎回及转换转出业务的公告》，本基金自 2021 年 3 月 22 日起开放日常赎回及转换转出业务。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华汇盈一年持有期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 《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华汇盈一年持有期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住所。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