

# 银华港股通精选股票型发起式证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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：2022 年 3 月 29 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。本年度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 2022 年 3 月 25 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
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 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	22
4.9 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>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	22
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 .....	22
5.3 托管人对本年度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 审计报告</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	23
6.2 审计报告的基本内容 .....	23
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>25</b>
7.1 资产负债表 .....	25
7.2 利润表 .....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	27
7.4 报表附注 .....	29
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	54
8.3 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
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	61
8.6 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 .....	61
8.7 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 .....	61
8.8 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 .....	61
8.9 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 .....	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3 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情况 .....	64
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	64
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
11.2 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 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>74</b>
12.1 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 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>76</b>
13.1 备查文件目录 .....	76
13.2 存放地点 .....	76
13.3 查阅方式 .....	76

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华港股通精选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	银华港股通精选股票发起式	
基金主代码	009017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 1 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	89,936,288.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	银华港股通精选股票发起式 A	银华港股通精选股票发起式 C
下属分级基金的交易代码	009017	014052
报告期末下属分级基金的份额总额	89,105,728.57 份	830,559.46 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例；根据国家政治经济政策精神，确定可投资的行业范围。</p> <p>本基金为股票型基金，将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，适当进行短期的战术避险选择。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票投资比例为基金资产的 80%—95%，其中港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
业绩比较基准	恒生中国企业指数收益率（使用估值汇率折算）×85%+银行人民币活期存款利率（税后）×15%
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金将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。</p>

### 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	010-66596688
	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 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	《上海证券报》
登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年	2021 年 12 月 3 日 (基金合同生效 日)-2021 年 12 月 31 日	2020 年 4 月 1 日(基金 合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	2020 年
	银华港股通精选股票发 起式 A	银华港股通精选股 票发起式 C	银华港股通精选股票 发起式 A	银华港股通 精选股票发 起式 C
本期已 实现收 益	-8,820,080.41	-36,998.61	-1,587,284.78	-
本期利 润	-30,031,231.40	-35,341.22	9,166,271.58	-
加权平 均基金	-0.3306	-0.0831	0.2037	-

份额本期利润				
本期加权平均净值利润率	-23.29%	-7.22%	16.33%	-
本期基金份额净值增长率	-16.47%	-7.38%	37.86%	-
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	-6,089,098.79	-56,770.42	-1,166,491.79	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0683	-0.0684	-0.0227	-
期末基金资产净值	102,614,003.42	956,455.22	70,937,938.35	-
期末基金份额净值	1.1516	1.1516	1.3786	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	15.16%	-7.38%	37.86%	-

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

银华港股通精选股票发起式 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
过去三个月	-15.01%	1.75%	-6.24%	1.02%	-8.77%	0.73%
过去六个月	-26.91%	2.12%	-20.74%	1.29%	-6.17%	0.83%
过去一年	-16.47%	2.11%	-21.85%	1.21%	5.38%	0.90%
自基金合同生效起至今	15.16%	1.96%	-19.62%	1.16%	34.78%	0.80%

银华港股通精选股票发起式 C

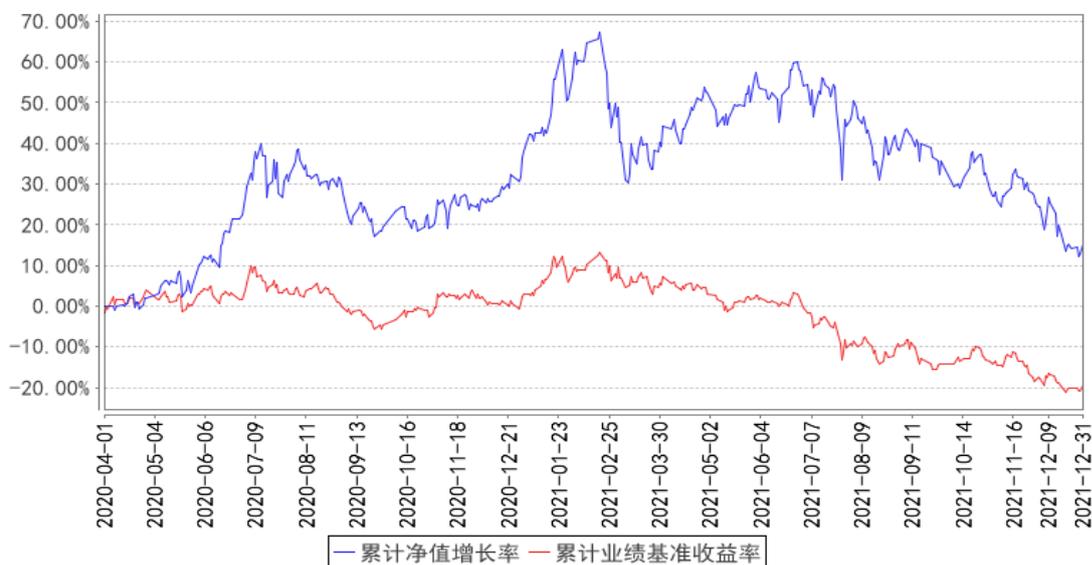
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-7.38%	2.16%	-2.69%	1.09%	-4.69%	1.07%

注：本基金的业绩比较基准为：恒生中国企业指数收益率(使用估值汇率折算)\*85%+银行人民币活期存款利率(税后)\*15%

恒生中国企业指数是恒生指数有限公司编制的，反映了在香港交易所上市的 H 股中较大型股的表现。该指数以所有在联交所上市的中国 H 股公司股票为成份股计算得出加权平均股价指数，适合作为本基金港股投资部分的业绩比较基准。本基金是股票型基金，本基金股票投资比例为基金资产的 80%—95%，其中港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。总之，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较好的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

银华港股通精选股票发起式A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



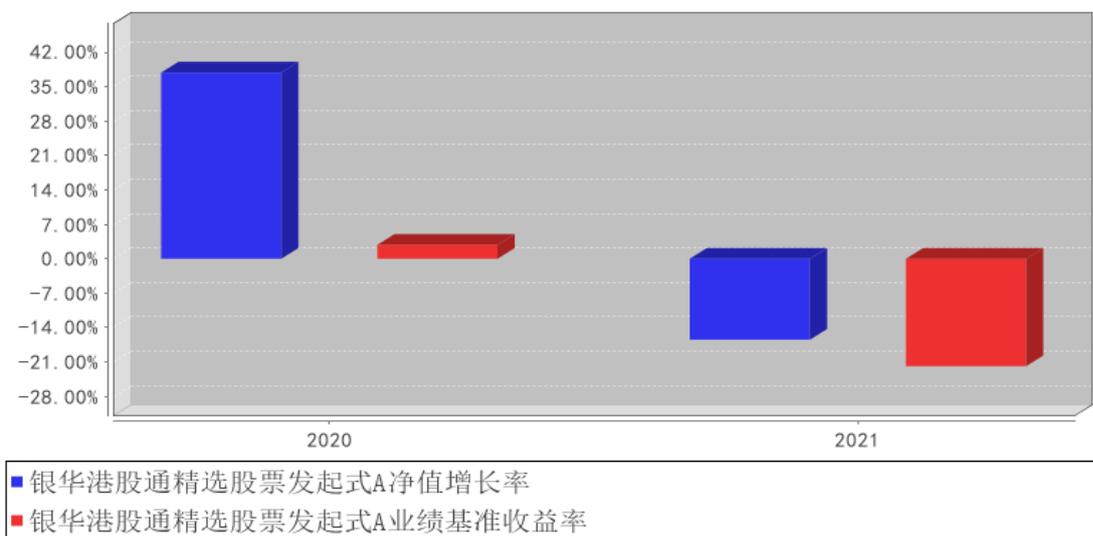
银华港股通精选股票发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



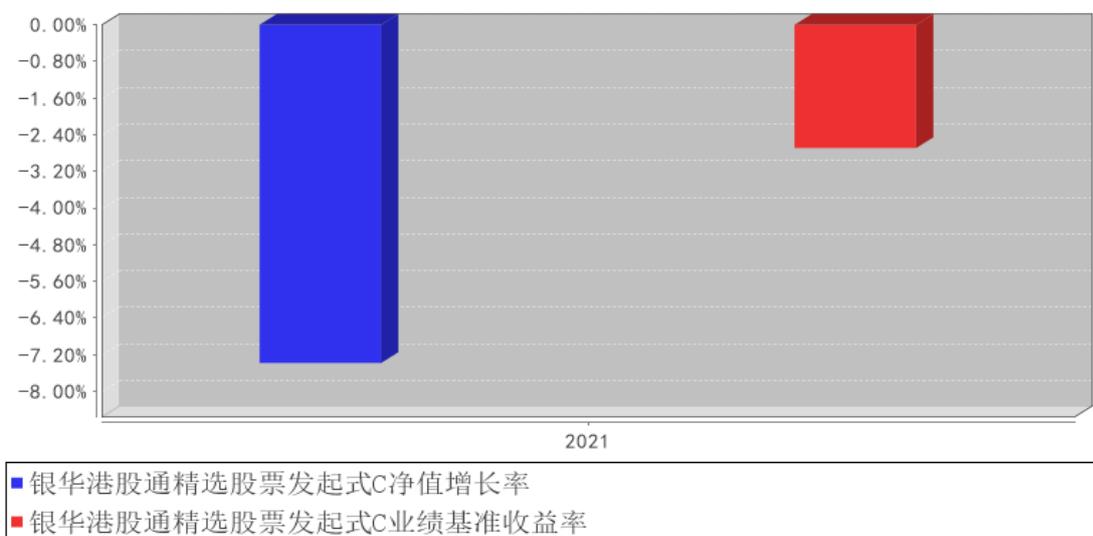
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金股票投资比例为基金资产的 80%—95%，其中港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银华港股通精选股票发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



银华港股通精选股票发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2021年度、2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间未进行利润分配。

## § 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 12 月 31 日，本基金管理人管理着 159 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、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华华智三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。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		
程程先生	本基金的基金经理	2020年4月1日	-	13.5年	硕士学位。曾就职于天弘基金、中信证券、安永华明会计师事务所，2018年10月加入银华基金，现任投资管理一部基金经理。自2019年3月22日起担任银华裕利混合型发起式证券投资基金基金经理，自2019年3月27日起兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自2019年12月16日起兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2020年4月1日起兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2021年1月11日起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。国籍：中国。
张萍女士	本基金的基金经理	2020年4月1日	-	11.5年	硕士学位。曾就职于中信建投证券股份有限公司，于2015年8月加入银华基金，历任行业研究员、投资经理职务，现任投资管理一部基金经理。自2018年11月6日起担任银华中小盘精选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基金经理，自2018年11月6日至2020年9月2日兼任银华估值优势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基金经理，自2019年3月19日起兼任银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年9月20日起兼任银华心怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年12月16日起兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2020年4月1日起兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年11月11日起兼任银华品质消费股票型证券投资基金基金经理，自2021年3月4日起兼任银华心享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2022年1月20日起兼任银华心兴三年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2022年2月23日起兼任银华心选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 晓 星 先 生	本基金的 基金经理	2020 年 4 月 1 日	2021 年 8 月 18 日	10.5 年	硕士学位。2006 年至 2010 年期间任职于 ABB 有限公司，历任运营发展部运营顾问，集团审计部高级审计师等职务；2011 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理职务。自 2015 年 7 月 7 日起担任银华中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月 22 日起兼任银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 8 月 11 日至 2020 年 11 月 20 日兼任银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 3 日至 2020 年 9 月 2 日兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 12 日起兼任银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 7 月 5 日起兼任银华心怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 15 日至 2019 年 9 月 20 日兼任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、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 16 日起兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 1 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 30 日起兼任银华丰享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 8 日起兼任银华心佳两年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 4 日起兼任银华心享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 20 日起兼任银华心兴三年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2022 年 2 月 23 日起兼任银华心选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。
王 璐 女 士	本基金的 基金经理 助理	2021 年 6 月 11 日	-	6.5 年	硕士学位。曾就职于九泰基金管理有限公司，2017 年 8 月加入银华基金，历任基金经理助理、行业研究员，现任投资管理一部基金经理助理。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、《银华港股通精选股票型发起式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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资管理制度和细则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

### 4.3.3 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3次,原因是量化投资组合和指数型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

报告期内,恒生指数先扬后抑,年度收跌-14.08%。其中,医疗保健、科技行业跌幅居前,公

用事业、能源类表现相对较好。

我们认为，后续随着相关政策逐步落地，利空逐渐出尽。且港股当前估值较低，部分资产已经具备显著的估值优势。操作上，我们继续保持高仓位，消费、科技、价值均衡配置，消费方面重点配置可选消费、医药生物等稀缺资产；科技方面主要配置新能源、电子相关行业，精选高景气行业中高增长的个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华港股通精选股票发起式 A 基金份额净值为 1.1516 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.47%，业绩比较基准收益率为-21.85%；截至本报告期末银华港股通精选股票发起式 C 基金份额净值为 1.1516 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.38%，业绩比较基准收益率为-2.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

##### 一、2021 年市场回顾：

今年的宏观经济主要压力来自以下几个方面：一是房地产市场传导的压力，二是基建投资不及预期，三是疫情的反复。在此背景下，流动性相比去年更为宽松，二级市场总体上来说还是给投资者创造了正收益。回顾 2020 年底我们对于 2021 年市场的几个判断，主要集中在两句话，“聚焦比较优势，回避犀牛风险”。现在从后视镜往回看，当时说对了一句半。“犀牛风险”是众所周知的与房地产相关的业务，今年地产链相关的股票、债券都出现了一定的波动，整体收益不佳。“比较优势”主要是指科技制造业和消费升级两个方面：今年与硬科技相关的，如新能源、半导体等行业都表现的非常好，其中能享受工程师红利的科技制造业表现非常突出，与商业模式相关的软科技则表现相对差一些；但受宏观环境影响以及疫情的反复，关系到绝大多数人就业的中小微企业的经营遇到了些困难，居民在对于收入预期不明朗的情况下，消费支出会受到压制，整体消费板块表现弱势。

“苔花如米小，也学牡丹开。”二级市场是公平的，每一类的资产都会有自己的表现时间，优秀的公司无论大小，只要业绩持续兑现，最终都会被市场认可，只是时间的问题。今年的大小盘股票表现差异很大，中证 1000 指数远远跑赢沪深 300 指数。这样的市场走势的背景是异常宽松的流动性、行业龙头的反垄断和经济的调结构，还有就是年初的时候中小市值的估值处于历史低位，而行业龙头的估值处于历史高位。宏观经济的压力叠加流动性宽松的组合，天然更适合小市值股票，此外，小市值股票还有“专精特新”的加持。这就像 2015 年，在“大众创业、万众创新”的助推下，叠加流动性宽松，小市值股票涨幅非常大。其中不乏优质的小市值公司通过自己的努力经营使得业绩快速增长，但不可否认的是，也有相当数量的小市值公司，上涨只是靠一些牵强的

逻辑和预期的演绎，没有基本面支撑的公司在潮水退去的时候就能看到是否在裸泳了。

“一期荣华一杯酒，炼刚化为绕指柔。”去年底，核心资产是万众瞩目的焦点，长坡厚雪是投资者口中出现最多的关键词，许多未来业绩增速中枢一般的优质公司的估值被推到了历史高位。我们认为这些公司的长期成长性和在行业中的领先优势并没有发生变化，只是过高的估值需要一些时间来化解，对于他们其中的绝大多数公司来说，今年是消化估值的一年。一年不到的时间，核心资产的关注度从趋之若鹜变成了门可罗雀。对于任何投资标的来说，看好他的原因和看空他的原因在任何一个时间段都会是充足的，而从我们的角度出发，我们还是希望去抓住一些主要矛盾。那就是这些优质公司所处的行业还有空间吗？公司在自己的行业里还有领先优势吗？公司目前的估值是否匹配长期增长中枢？如果这些答案都是肯定的，那近期是不是提供了以合理的价格买入这些优质龙头公司的机会？

“谁怜不得意，长剑独归来。”年初时候的百万雄狮过香江、南下抢夺定价权的豪言壮语犹言在耳，到了年末，大部分投资者已经进入了谈港股色变的状态。因为资金属性和交易环境的不同，港股市场相对于 A 股市场的折价会长期存在，短时间内期许 A/H 差价的迅速抹平都是不现实的。抛开一直存在的差价不谈，只看现在港股的估值水平，相对于港股自身的历史水平也降到了低点，当下也不应该是再拿着放大镜找缺点的时候，我们对于港股明年提供一个合理的收益预期是有信心的。

## 二、2022 年市场展望：

展望 2-3 年的维度，我们认为以下的三件事是会发生的：

1) 新冠逐步的流感化。我们盼望张医生所说的会成真，2021 年会是抗击疫情的最后一个寒冬。随着全球新冠疫苗接种率的提升，以及新冠特效药的不断开发，新冠的重症率和死亡率会显著下降，最终新冠的伤害力会流感化。各个国家的国门会走向开放，文化交流和商业贸易会逐步恢复正常，封闭会使得国家间的误解加深，而开放和交流会使得国家间的信任加深，毕竟更好的生活品质是全球的主流追求。

2) 经济逐步的上台阶。今年因为房地产市场的风险，消费的低迷以及疫情的反复，叠加去年的基数效应，整体经济走势是前高后低，这个对于顺周期标的的投资是非常不利的。现在我们可以看到高层提出六稳六保，以经济建设为中心，各个行业的稳增长措施在相继出台，相信在明年会逐步发挥作用。我们同时可以看到，高层对于中小微企业的支持是最为明显的。市场往往认为上市公司里面的中小企业就是中小微企业的代表，其实这个是错误的，能够上市的企业基本都不在中小微企业的范畴。那中小微企业对应的投资标的是什么呢？我们认为是消费相关，中小微企业解决了 90%以上的居民就业，中小微企业的经营状况也就决定大部分居民的收入预期。今年整

体消费不好的原因就是中小微企业的经营困难，我们相信中小微企业的经营改善会带动就业和大众的收入，从而提升大众消费的能力，最终带动经济进入到良性发展过程中。

3) 流动性逐步的回归正常。随着疫情的逐步流感化以及经济的逐步上台阶，流动性会逐渐的回归正常。核心资产里面都是各个行业的龙头，而各个行业的龙头跟经济的相关性是更大的。看 2-3 年的维度，在经济上行流动性下行的大背景下，核心资产的超额往往是更大的。我们近期行业调研的结论是，龙头公司在过去一年的领先优势并没有减小，在很多行业反而是加大的，然后有很多公司的估值反而在行业内变得是相对便宜的。优质公司的表现时间迟早会来临，就像 2015 年之后，流动性潮水退去的时候，就是优质龙头公司表现的甜蜜时光了。

结合我们对于宏观环境的判断，我们对于 2022 年的市场观点也可以总结成两句话，“碳中和、稳消费，聚焦核心资产。”希望我们对于 2022 年市场判断的正确率可以比 2021 年更高一些，能对两句话。

### 三、科技行业展望：

“他日登高天地宽”，科技股的投资就是投资变化，投资变化受益的方向，投资壁垒形成的过程。成长股涨幅最大的阶段不是在最终壁垒形成后的稳态格局，而是在壁垒形成的过程中。从整体的科技产业变化来看，正在发生两大变化，即能源结构的变化和地缘政治的变化。能源结构的变化指是在未来 30-50 年当中，能源的主要供应方式从化石能源逐渐转变为非化石能源，使用汽油的交通工具也会逐渐转变为消耗电能的交通工具。而地缘政治的变化映射到科技股当中，主要集中在卡脖子环节的国产替代方向，以及我们相对不是很在行的军工方向。

从能源结构转变的角度来看新能源，其产业趋势是没有结束的。能源生产端，风光渗透率离目标还差的比较远。能源消费端，国内纯电动车（不含混动）的渗透率还不到 15%，全球的渗透率也不超过 10%。随着风光渗透率提升以及电力消费效率提升，新型电力网络的建设方兴未艾。发电端风光占比的提升、电网侧安全的加强和用电侧峰谷差价的拉大将推动储能的快速发展。光伏、风电、电网设备、储能和电动车仍将有大量投资机会。当然，上述 5 个细分方向的投资机会在 2021 年已经被较为充分的挖掘了，甚至有些是股价走在基本面前面了。这增加了 2022 年的投资难度，2022 年要在产业链环节选择上和个股挖掘上多着力些。

我国在信息技术发展中尚有较多高附加值但亟待解决的卡脖子环节，在国家政策支持下，国产替代迎来历史机遇，我们努力挖掘各细分领域龙头从 1 到 N 的投资机会。半导体 2021 年的主线是全球缺货涨价，2022 年主线将切换到创新周期和国产替代，个股表现将分化。细分方向上，我们看好车用半导体和设备材料国产化。其中，汽车的电动化和智能化已进入加速阶段，将带动半导体单车用量提升，而供给端验证门槛高，车用半导体会在未来相当长的时间维持高景气度。而

国内晶圆厂的快速扩产会带动上游设备、材料国产化，相较于景气度二阶导属性的半导体设备，从投资角度上我们更看好耗材属性的半导体材料，以及国产化率低、有望实现非线性增长的设备零部件。

5G 产业链的投资，我们遵循技术成熟曲线和投资回报的匹配度，在业绩驱动的投资框架下，现阶段仍是硬件投资方向最为确定；软件应用侧，大部分产业处于萌芽期，尚无成熟的商业模式，保持积极关注。技术创新角度，看好 VR/AR 创新周期、汽车智能化和 AIOT 对相关半导体和消费电子的硬件拉动，以及受益于企业端数字化和智能化转型的安防产业链。

2021 年，互联网行业在政策强监管和流量红利见顶的背景下，盈利能力和估值受到了双重压制。展望 2022 年，我们认为行业估值下行的空间有限，超额收益来源于业绩增长和估值修复。细分行业里我们看好低估值顺周期以及游戏。在低估值顺周期方向，我们看好长期受益消费升级红利的品牌广告。效果广告 ROI 由于线上流量红利见顶而持续下降，品牌广告相对性价比凸显。品牌广告的代表，梯媒有别于传统营销媒体，需求以及行业格局更加稳定，在以经济建设为中心的背景下，需求有望出现率先反弹。相关龙头公司在前期跟随消费板块休整后，当前具备可观的绝对收益空间。游戏业绩的核心驱动力来自于出海，作为文化出海的代表性行业，展望 22 年，游戏公司海外收入占比有望持续提升，我们看好海外收入占比及增速较高的游戏公司。元宇宙是代表未来的方向，目前相关标的处于概念形成初期估值扩张的阶段，相关标的存在较大不确定性，我们会持续关注新技术发展变化。

#### 四、消费行业展望：

“沧海浮沉若云烟”，如果说科技投资的是变化，那消费给我们提供的就是确定性和稳定性。从收入端和利润端来看，消费品公司明年业绩将回归正常经营状态，同时也出现了估值切换的空间。2021 年对于消费无疑是外部因素变化很大的一年，全年疫情的反复扰动、反垄断、强监管等行业政策，以及限产限电、原材料成本的大幅上行，导致业绩逐季放缓，估值持续承压。但历史上每一次恶劣的外部环境都会强化优质公司竞争力，也更有利于格局的优化。我们认为 2022 年这些负面因素都会弱化，整体消费的投资会比 21 年更加乐观。

消费的细分行业上，我们看好高端白酒和有全国化扩张潜力的次高端，四季度我们加仓白酒配置，因为看见积极因素不断积累，改革信号的明显，强化了中长期业绩确定性。大众消费品预计在二季度会有更好的表现，我们看好有涨价弹性的调味品，以及受疫情压制较大的餐饮供应链复苏。养殖行业明年也有机会，需要逐步验证拐点，但这一轮周期的力度会明显弱于上一次，对标的的选择要更注重成长性。新兴消费现在处在消化估值的过程中，会有不同赛道的分化，要自下而上地挖掘个股机会。

2021 年医药板块跌宕起伏，核心资产由于种种原因没有获得我们期望的收益率，然而全年医药板块还是有 30% 以上的个股涨幅超过 20%。CRO/CDMO、医美、上游装备耗材、中药都有自己的高光时刻，兼容并包、百花齐放。我们抓住了一些机会，也错失了很多机会。我们坚信医药还会是长牛行业，只是我们需要更辛苦、更勤奋的去挖掘标的，寻找未被认知的机会。展望 2022 年，我们会在 CRO/CDMO 板块中优中选优；继续持有政策环境友好、业绩增长稳健的医疗器械和研发实力强劲、业绩持续兑现的疫苗龙头；逐步买入业绩有望在疫情后恢复的消费医疗；并择机配置低估值、基本面改善明显的其他优质标的。

#### 五、价值行业展望：

在以经济建设为中心的大背景下，我们认为顺周期的大多数价值股会有一定绝对收益，超额收益多少需要看经济修复的力度。银行股是我们较为看好的板块，虽然 2022 年整体收入和盈利增速回到正常水平，但零售银行和经济发达区域的城商行依旧会保持较高增速。另外，该类银行资产质量受经济波动较小，在不良资产大规模出清后，其信用成本会明显下行，由此反哺利润增长。券商股中的财富管理赛道也是我们相对看好的板块，财富管理周期性较弱，而且盈利增速快于其他业务子板块，未来前景广阔，因此我们看好财富管理业务收入和盈利占比相对较高的券商。地产行业边际的确有改善，但长期景气度确定性下行，在我们的投资框架中，并不十分接受该类博弈型的行业，但在本轮民营地产风险暴露的过程中，国有地产公司相对受益，可以获得更高的行业集中度，因此我们对地产持中性态度。保险行业的估值处于历史低位，但其基本面的修复还没有到来，需要保持关注。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了监察稽核机制，根据不同基金的特点与公司业务发展情况，及时界定新的合规风险点，并在年初制定监察稽核工作计划及重点，以专项检查或抽查的形式对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务环节进行检查。

本基金管理人始终坚持以法律法规及公司制度为基础，不断查缺补漏，确保本基金的安全、合规运作，在投资研究交易环节，主要包括对研究报告合规性、股票库建立及完善情况、基金投资比例的日常监控情况、关联交易的日常维护情况以及公平交易执行情况的合规检查；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值等业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、跟踪检查报告或监察提示函的形式，及时将潜在风险通报部门总监、分管领导、督察长及

公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

#### 4.7 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历。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 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”）在银华港股通精选股票型发起式证券投资基金（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 托管人对本年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 23559 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华港股通精选股票型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了银华港股通精选股票型发起式证券投资基金(以下简称“银华港股通精选股票发起式”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了银华港股通精选股票发起式 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华港股通精选股票发起式，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	银华港股通精选股票发起式的基金管理人银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会

	<p>计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银华港股通精选股票发起式的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算银华港股通精选股票发起式、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银华港股通精选股票发起式的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银华港股通精选股票发起式持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华港股通精选股票发起式不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师的姓名	薛 竞	周 祎
会计师事务所的地址	中国 上海市	
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银华港股通精选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	7,434,288.57	4,351,017.76
结算备付金		32,921.23	2,818,170.84
存出保证金		27,190.42	3,934.52
交易性金融资产	7.4.7.2	96,664,161.70	64,546,135.77
其中：股票投资		96,664,161.70	63,452,271.87
基金投资		-	-
债券投资		-	1,093,863.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,116,087.19
应收利息	7.4.7.5	1,821.20	20,315.44
应收股利		29,359.08	-
应收申购款		-	100,781.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		104,189,742.20	72,956,443.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		17.38	0.06
应付赎回款		98,899.93	1,802,887.34
应付管理人报酬		132,364.60	88,752.15
应付托管费		22,060.77	14,792.04
应付销售服务费		150.07	-

应付交易费用	7.4.7.7	195,625.84	57,421.13
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,164.97	54,652.38
负债合计		619,283.56	2,018,505.10
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	89,936,288.03	51,456,958.22
未分配利润	7.4.7.10	13,634,170.61	19,480,980.13
所有者权益合计		103,570,458.64	70,937,938.35
负债和所有者权益总计		104,189,742.20	72,956,443.45

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 89,936,288.03 份，其中银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 A 类基金份额净值 1.1516 元，银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 A 类基金份额 89,105,728.57 份；银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 C 类基金份额净值 1.1516 元，银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 C 类基金份额 830,559.46 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银华港股通精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-24,981,557.43	10,458,478.01
1. 利息收入		102,456.20	50,354.32
其中：存款利息收入	7.4.7.11	78,192.99	29,625.34
债券利息收入		24,263.21	20,728.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,483,489.63	-629,486.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-5,124,390.53	-918,322.82
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-25,406.60	-1,319.30
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	666,307.50	290,155.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-21,209,493.60	10,753,556.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	608,969.60	284,053.77
减：二、费用		5,085,015.19	1,292,206.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,942,373.65	625,928.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	323,728.94	104,321.31
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	150.07	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,633,971.17	502,482.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	184,791.36	59,474.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-30,066,572.62	9,166,271.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-30,066,572.62	9,166,271.58

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华港股通精选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	51,456,958.22	19,480,980.13	70,937,938.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-30,066,572.62	-30,066,572.62
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）	38,479,329.81	24,219,763.10	62,699,092.91

其中：1. 基金申购款	152,912,110.35	75,029,312.59	227,941,422.94
2. 基金赎回款	-114,432,780.54	-50,809,549.49	-165,242,330.03
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）	89,936,288.03	13,634,170.61	103,570,458.64
项目	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31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）	13,669,937.44	-	13,669,937.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,166,271.58	9,166,271.58
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）	37,787,020.78	10,314,708.55	48,101,729.33
其中：1. 基金申购款	84,231,913.06	23,345,987.61	107,577,900.67
2. 基金赎回款	-46,444,892.28	-13,031,279.06	-59,476,171.34
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）	51,456,958.22	19,480,980.13	70,937,938.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银华港股通精选股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2020]209号《关于准予银华港股通精选股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准,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》和《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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13,669,725.00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0251号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同》于2020年4月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为13,669,937.44份基金份额,其中认购资金利息折合212.44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”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,200.02基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票(以下简称“港股通标的股票”)、内地依法发行上市的股票(包括创业板股票、中小板股票、存托凭证以及其他依法发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货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)。本基金股票投资比例为基金资产的80%—95%,其中港股通标的股票投资比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终,扣除股指期货需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:恒生中国企业指数收益率(使用估值汇率折算)×85%+银行人民币活期存款利率(税后)×15%。

根据《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》等法律法规的规定和《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同》的相关约定,为满足投资者的需求,提供更灵活的理财服务,本基金管理人经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,决定自2021年12月3日起增设本基金的C类基金份额类别并相应修改基

金合同。本基金根据销售服务费、赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。本基金原有基金份额划归为本基金 A 类基金份额，A 类基金份额在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用；本基金增设的 C 类基金份额不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

本财务报表由本基金的基金管理人银华基金管理股份有限公司于 2022 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 1 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性

金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管

理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场, 采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时, 优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件, 应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项, 根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分, 将本金部分冲减资产支持证券投资成本, 并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	7,434,288.57	4,351,017.76
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	7,434,288.57	4,351,017.76

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	107,120,098.94	96,664,161.70	-10,455,937.24	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	合计	-	-	
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	107,120,098.94	96,664,161.70	-10,455,937.24	
项目	上年度末			
	2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	52,685,227.81	63,452,271.87	10,767,044.06	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,107,351.60	1,093,863.90	-13,487.70
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,107,351.60	1,093,863.90	-13,487.70
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	53,792,579.41	64,546,135.77	10,753,556.36	

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：无。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

注：无。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	1,259.01	543.44
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	552.95	338.64
应收债券利息	-	19,429.57
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	-	1.81
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	9.24	1.98
合计	1,821.20	20,315.44

**7.4.7.6 其他资产**

注：无。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	195,625.84	57,421.13
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	195,625.84	57,421.13

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	164.97	4,652.38
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	50,000.00
合计	170,164.97	54,652.38

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

## 银华港股通精选股票发起式 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	51,456,958.22	51,456,958.22
本期申购	152,062,027.84	152,062,027.84
本期赎回 (以“-”号填列)	-114,413,257.49	-114,413,257.49
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	89,105,728.57	89,105,728.57

## 银华港股通精选股票发起式 C

项目	本期 2021 年 12 月 3 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	850,082.51	850,082.51
本期赎回 (以“-”号填列)	-19,523.05	-19,523.05
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	830,559.46	830,559.46

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 银华港股通精选股票发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,166,491.79	20,647,471.92	19,480,980.13
本期利润	-8,820,080.41	-21,211,150.99	-30,031,231.40
本期基金份额交易产生的变动数	3,897,473.41	20,161,052.71	24,058,526.12
其中：基金申购款	10,228,912.88	64,636,262.63	74,865,175.51
基金赎回款	-6,331,439.47	-44,475,209.92	-50,806,649.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,089,098.79	19,597,373.64	13,508,274.85

## 银华港股通精选股票发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-36,998.61	1,657.39	-35,341.22
本期基金份额交易产生的变动数	-19,771.81	181,008.79	161,236.98
其中：基金申购款	-20,675.67	184,812.75	164,137.08
基金赎回款	903.86	-3,803.96	-2,900.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-56,770.42	182,666.18	125,895.76

## 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	36,970.77	17,042.23
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	37,818.22	10,727.00
其他	3,404.00	1,856.11
合计	78,192.99	29,625.34

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,124,390.53	-918,322.82
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	-5,124,390.53	-918,322.82

#### 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	649,402,237.39	105,635,666.79
减：卖出股票成本总额	654,526,627.92	106,553,989.61
买卖股票差价收入	-5,124,390.53	-918,322.82

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31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	-25,406.60	-1,319.30
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	-25,406.60	-1,319.30

##### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,104,976.78	838,531.90

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,107,351.60	818,559.00
减：应收利息总额	23,031.78	21,292.20
买卖债券差价收入	-25,406.60	-1,319.30

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

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12月31日	2020年4月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	666,307.50	290,155.68
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	666,307.50	290,155.68

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年4月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-21,209,493.60	10,753,556.36
股票投资	-21,222,981.30	10,767,044.06
债券投资	13,487.70	-13,487.70
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	-21,209,493.60	10,753,556.36

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年4月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	608,969.60	284,053.77
合计	608,969.60	284,053.77

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年4月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
交易所市场交易费用	2,633,971.17	502,482.77
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,633,971.17	502,482.77

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年4月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	14,791.36	6,321.15
其他	-	400.00
证券组合费_港股通	-	2,753.08
合计	184,791.36	59,474.23

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
第一创业证券股份有限公司(“第一创	基金管理人股东

业”)	
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人股东
山西海鑫实业有限公司	基金管理人股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
银华长安资产管理(北京)有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年4月1日(基金合同生效日) 至2020年12月31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(%)
第一创业	22,675,597.78	1.67	206,650.50	0.08
西南证券	34,794,656.74	2.56	3,692,546.00	1.39

###### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2020年4月1日(基金合同生效日)至 2020年12月31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	111,945.00	100.00	959,798.70	46.43

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 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12月31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 (%)
第一创业	21,117.91	1.89	2,194.11	1.12
西南证券	32,404.52	2.89	2,696.28	1.38
关联方名称	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31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	3,438.84	1.61	-	-
第一创业	192.44	0.09	192.44	0.34

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合 同生效日）至2020年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,942,373.65	625,928.12
其中：支付销售机构的客户维护费	645,540.82	173,525.65

注：支付基金管理人银华基金管理股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	323,728.94	104,321.31

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华港股通精选股票发起式 A	银华港股通精选股票发起式 C	合计
银华基金	-	63.64	63.64
合计	-	63.64	63.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华港股通精选股票发起式 A	银华港股通精选股票发起式 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给银华基金，再由银华基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 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。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	本期 2021年12月3日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
	银华港股通精选股票发起式 A	银华港股通精选股票发起式 C
基金合同生效日（2020年4月1日）持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	11.12%	-
项目	上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效 日）至2020年12月31日	上年度可比期间 -
	银华港股通精选股票发起式 A	银华港股通精选股票发起式 C
基金合同生效日（2020年4月1日）持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	19.43%	-

## 7.4.10.5.2 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

注：无。

**7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年4月1日（基金合同生效日）至2020年12月31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	7,434,288.57	36,970.77	4,351,017.76	17,042.23

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。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

注：无。

**7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券**

注：无。

**7.4.13 金融工具风险及管理****7.4.13.1 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。

**7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	7,434,288.57	-	-	-	7,434,288.57
结算备付金	32,921.23	-	-	-	32,921.23
存出保证金	27,190.42	-	-	-	27,190.42
交易性金融资产	-	-	-	96,664,161.70	96,664,161.70
应收利息	-	-	-	1,821.20	1,821.20
应收股利	-	-	-	29,359.08	29,359.08
资产总计	7,494,400.22	-	-	96,695,341.98	104,189,742.20
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	98,899.93	98,899.93
应付管理人报酬	-	-	-	132,364.60	132,364.60
应付托管费	-	-	-	22,060.77	22,060.77
应付证券清算款	-	-	-	17.38	17.38
应付销售服务费	-	-	-	150.07	150.07
应付交易费用	-	-	-	195,625.84	195,625.84
其他负债	-	-	-	170,164.97	170,164.97
负债总计	-	-	-	619,283.56	619,283.56
利率敏感度缺口	7,494,400.22	-	-	96,076,058.42	103,570,458.64
<b>上年度末 2020年12月31日</b>					
<b>资产</b>					
银行存款	4,351,017.76	-	-	-	4,351,017.76
结算备付金	2,818,170.84	-	-	-	2,818,170.84
存出保证金	3,934.52	-	-	-	3,934.52
交易性金融资产	1,093,863.90	-	-	63,452,271.87	64,546,135.77
应收证券清算款	-	-	-	1,116,087.19	1,116,087.19
应收利息	-	-	-	20,315.44	20,315.44
应收申购款	-	-	-	100,781.93	100,781.93
资产总计	8,266,987.02	-	-	64,689,456.43	72,956,443.45
<b>负债</b>					

应付证券清算款	-	-	-	0.06	0.06
应付赎回款	-	-	-	1,802,887.34	1,802,887.34
应付管理人报酬	-	-	-	88,752.15	88,752.15
应付托管费	-	-	-	14,792.04	14,792.04
应付交易费用	-	-	-	57,421.13	57,421.13
其他负债	-	-	-	54,652.38	54,652.38
负债总计	-	-	-	2,018,505.10	2,018,505.10
利率敏感度缺口	8,266,987.02	-	-	62,670,951.33	70,937,938.35

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	82,957,211.68	-	82,957,211.68
资产合计	-	82,957,211.68	-	82,957,211.68
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	82,957,211.68	-	82,957,211.68
项目	上年度末 2020年12月31日			

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	56,630,471.22	-	56,630,471.22
交易性金融资 产	-	56,630,471.22	-	56,630,471.22
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	56,630,471.22	-	56,630,471.22

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化率变化 5%，其他变量不变 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
	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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	港币 5%	4,147,860.58	2,831,523.56
	港币-5%	-4,147,860.58	-2,831,523.56

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 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	96,664,161.70	93.33	63,452,271.87	89.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	1,093,863.90	1.54
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	96,664,161.70	93.33	64,546,135.77	90.99

#### 7.4.13.4.3.2 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。		
	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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	6,443,291.32	3,831,842.02
	业绩比较基准下降 5%	-6,443,291.32	-3,831,842.02

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 96,664,161.70 元，无属于第二或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 63,452,271.87 元，第二层次 1,093,863.90 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	96,664,161.70	92.78
	其中：股票	96,664,161.70	92.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	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	7,467,209.80	7.17
8	其他各项资产	58,370.70	0.06
9	合计	104,189,742.20	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。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,671,151.42	9.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,591,000.00	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,129,128.00	1.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	588,300.00	0.57
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	727,370.60	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	13,706,950.02	13.23

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	12,129,995.36	11.71

消费者非必需品	14,579,676.22	14.08
消费者常用品	8,354,563.84	8.07
能源	-	-
金融	11,893,999.21	11.48
医疗保健	33,568,661.05	32.41
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	1,323,040.32	1.28
地产建筑业	1,107,275.68	1.07
合计	82,957,211.68	80.10

### 8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	02269	药明生物	123,500	9,345,106.68	9.02
2	00388	香港交易所	21,700	8,079,670.37	7.80
3	01772	赣锋锂业	65,400	6,560,896.61	6.33
4	01951	锦欣生殖	782,500	5,572,414.12	5.38
5	02899	紫金矿业	734,000	5,569,098.75	5.38
6	01548	金斯瑞生物科技	192,000	5,415,782.40	5.23
7	06078	海吉亚医疗	126,800	5,059,177.98	4.88
8	00168	青岛啤酒股份	84,000	5,013,523.20	4.84
9	03347	泰格医药	60,500	4,897,015.20	4.73
10	09992	泡泡玛特	110,800	4,049,376.58	3.91
11	03998	波司登	1,000,000	4,014,416.00	3.88
12	00291	华润啤酒	64,000	3,341,040.64	3.23
13	000792	盐湖股份	73,400	2,597,626.00	2.51
14	02331	李宁	31,500	2,198,138.04	2.12
15	03908	中金公司	112,400	1,975,812.16	1.91
16	300633	开立医疗	61,300	1,957,309.00	1.89
17	06030	中信证券	110,500	1,838,516.68	1.78
18	301177	迪阿股份	12,500	1,591,000.00	1.54
19	09922	九毛九	138,000	1,545,754.56	1.49
20	02171	科济药业-B	65,000	1,461,460.00	1.41
21	300702	天宇股份	30,000	1,450,500.00	1.40
22	09869	海伦司	90,000	1,389,265.92	1.34
23	01999	敏华控股	140,000	1,382,725.12	1.34
24	00836	华润电力	62,000	1,323,040.32	1.28
25	06606	诺辉健康-B	69,000	1,246,758.24	1.20

26	301073	君亭酒店	32,900	1,129,128.00	1.09
27	06098	碧桂园服务	29,000	1,107,275.68	1.07
28	301087	可孚医疗	12,800	1,010,048.00	0.98
29	300595	欧普康视	17,100	981,027.00	0.95
30	688050	爱博医疗	4,354	915,341.42	0.88
31	600223	鲁商发展	44,400	588,300.00	0.57
32	06699	时代天使	2,800	570,946.43	0.55
33	600285	羚锐制药	34,500	545,100.00	0.53
34	301080	百普赛斯	2,500	527,825.00	0.51
35	603707	健友股份	5,100	214,200.00	0.21
36	688621	阳光诺和	1,641	199,545.60	0.19

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	00388	香港交易所	30,895,360.52	43.55
2	01951	锦欣生殖	28,590,624.15	40.30
3	01772	赣锋锂业	27,130,339.51	38.25
4	300122	智飞生物	25,880,123.01	36.48
5	03888	金山软件	23,695,550.16	33.40
6	02269	药明生物	18,886,335.06	26.62
7	00853	微创医疗	18,013,633.38	25.39
8	02359	药明康德	17,385,560.99	24.51
9	03759	康龙化成	17,126,591.02	24.14
10	03347	泰格医药	15,109,512.42	21.30
11	02899	紫金矿业	14,044,886.77	19.80
12	00460	四环医药	13,776,727.35	19.42
13	00700	腾讯控股	13,687,549.27	19.30
14	06127	昭衍新药	13,661,865.74	19.26
15	06078	海吉亚医疗	13,210,322.02	18.62
16	09926	康方生物-B	12,522,886.07	17.65
17	06855	亚盛医药-B	12,220,788.79	17.23
18	00268	金蝶国际	12,191,592.51	17.19
19	002821	凯莱英	11,615,559.00	16.37
20	06186	中国飞鹤	11,420,916.70	16.10
21	00839	中教控股	10,940,008.83	15.42
22	01548	金斯瑞生物科技	9,561,749.63	13.48
23	00981	中芯国际	9,411,906.00	13.27
24	00168	青岛啤酒股份	8,749,785.01	12.33
25	00916	龙源电力	8,518,268.81	12.01
26	00836	华润电力	8,510,964.59	12.00

27	00291	华润啤酒	8,492,480.36	11.97
28	300725	药石科技	8,468,291.40	11.94
29	688116	天奈科技	7,923,611.55	11.17
30	01530	三生制药	7,538,288.72	10.63
31	03690	美团-W	7,473,450.51	10.54
32	06185	康希诺生物-B	6,993,896.30	9.86
33	300595	欧普康视	6,882,030.40	9.70
34	02020	安踏体育	6,496,241.15	9.16
35	06618	京东健康	6,495,904.65	9.16
36	02331	李宁	6,428,736.01	9.06
37	01211	比亚迪股份	6,235,378.40	8.79
38	09992	泡泡玛特	5,986,973.94	8.44
39	09922	九毛九	5,834,144.51	8.22
40	688029	南微医学	5,123,062.95	7.22
41	01999	敏华控股	4,940,316.16	6.96
42	01177	中国生物制药	4,840,159.93	6.82
43	00667	中国东方教育	4,798,052.55	6.76
44	002594	比亚迪	4,699,697.00	6.63
45	01347	华虹半导体	4,676,143.66	6.59
46	01810	小米集团-W	4,613,341.19	6.50
47	02313	申洲国际	4,559,736.68	6.43
48	00522	ASM PACIFIC	4,558,937.42	6.43
49	03998	波司登	4,537,745.66	6.40
50	00027	银河娱乐	4,518,301.36	6.37
51	300896	爱美客	4,363,360.80	6.15
52	09996	沛嘉医疗-B	4,076,810.88	5.75
53	300760	迈瑞医疗	4,052,174.00	5.71
54	02601	中国太保	4,021,742.53	5.67
55	02333	长城汽车	3,980,793.51	5.61
56	01117	现代牧业	3,869,098.84	5.45
57	600276	恒瑞医药	3,784,232.60	5.33
58	02096	先声药业	3,769,933.61	5.31
59	01877	君实生物	3,706,063.10	5.22
60	600521	华海药业	3,640,802.00	5.13
61	01521	方达控股	3,618,184.82	5.10
62	03898	时代电气	3,393,069.53	4.78
63	688575	亚辉龙	3,355,158.52	4.73
64	09966	康宁杰瑞制药-B	3,337,805.60	4.71
65	01833	平安好医生	3,331,303.01	4.70
66	688050	爱博医疗	3,193,824.79	4.50
67	06865	福莱特玻璃	3,104,511.25	4.38

68	600827	百联股份	2,904,160.00	4.09
69	000301	东方盛虹	2,813,817.00	3.97
70	01811	中广核新能源	2,801,347.95	3.95
71	600763	通策医疗	2,786,925.00	3.93
72	00241	阿里健康	2,744,594.66	3.87
73	603520	司太立	2,586,570.00	3.65
74	06098	碧桂园服务	2,485,926.45	3.50
75	300573	兴齐眼药	2,400,308.24	3.38
76	688016	心脉医疗	2,387,916.10	3.37
77	603658	安图生物	2,366,222.00	3.34
78	000516	ST 国医	2,325,884.00	3.28
79	603260	合盛硅业	2,317,588.00	3.27
80	300601	康泰生物	2,248,483.00	3.17
81	000792	盐湖股份	2,226,895.00	3.14
82	688303	大全能源	2,174,420.01	3.07
83	09939	开拓药业-B	2,125,899.97	3.00
84	601567	三星医疗	2,122,316.94	2.99
85	300633	开立医疗	2,110,574.06	2.98
86	02171	科济药业-B	2,024,517.48	2.85
87	300294	博雅生物	2,009,732.00	2.83
88	301177	迪阿股份	1,977,274.78	2.79
89	301047	义翘神州	1,901,740.00	2.68
90	01579	颐海国际	1,824,438.43	2.57
91	06030	中信证券	1,776,101.95	2.50
92	03908	中金公司	1,771,874.28	2.50
93	600976	健民集团	1,755,065.00	2.47
94	688613	奥精医疗	1,683,175.68	2.37
95	300676	华大基因	1,680,701.95	2.37
96	09633	农夫山泉	1,633,020.34	2.30
97	300280	紫天科技	1,611,444.00	2.27
98	300015	爱尔眼科	1,610,681.00	2.27
99	06606	诺辉健康-B	1,575,074.09	2.22
100	002044	美年健康	1,546,795.00	2.18
101	09869	海伦司	1,540,657.03	2.17
102	603456	九洲药业	1,526,154.00	2.15
103	605499	东鹏饮料	1,520,776.00	2.14
104	02500	启明医疗-B	1,495,176.81	2.11
105	01515	华润医疗	1,467,068.30	2.07
106	06862	海底捞	1,463,616.23	2.06
107	300702	天宇股份	1,428,726.00	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。

## 8.4.2 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	01772	赣锋锂业	28,274,063.20	39.86
2	03888	金山软件	27,770,814.43	39.15
3	00388	香港交易所	26,802,464.47	37.78
4	300122	智飞生物	26,202,427.70	36.94
5	01951	锦欣生殖	19,133,544.47	26.97
6	02359	药明康德	18,587,773.44	26.20
7	03759	康龙化成	18,566,799.95	26.17
8	00700	腾讯控股	17,162,337.29	24.19
9	06186	中国飞鹤	15,043,100.15	21.21
10	00460	四环医药	15,037,630.05	21.20
11	00853	微创医疗	12,834,799.42	18.09
12	002821	凯莱英	12,604,391.06	17.77
13	02269	药明生物	11,937,123.95	16.83
14	06127	昭衍新药	11,932,387.33	16.82
15	09926	康方生物-B	11,428,139.18	16.11
16	00839	中教控股	11,380,507.96	16.04
17	00916	龙源电力	11,189,531.93	15.77
18	300725	药石科技	9,839,956.46	13.87
19	00268	金蝶国际	9,816,479.46	13.84
20	06855	亚盛医药-B	9,163,774.58	12.92
21	00836	华润电力	8,528,462.55	12.02
22	00291	华润啤酒	8,485,381.13	11.96
23	00981	中芯国际	8,441,611.43	11.90
24	03690	美团点评-W	8,209,311.21	11.57
25	688116	天奈科技	8,179,046.36	11.53
26	01211	比亚迪股份	8,007,301.94	11.29
27	03347	泰格医药	7,832,935.61	11.04
28	02899	紫金矿业	7,731,277.37	10.90
29	01810	小米集团-W	7,545,374.21	10.64
30	00667	中国东方教育	7,114,026.95	10.03
31	06185	康希诺生物-B	6,804,905.66	9.59
32	01530	三生制药	6,589,330.52	9.29
33	09922	九毛九	6,519,719.14	9.19
34	06078	海吉亚医疗	5,849,422.12	8.25
35	300595	欧普康视	5,665,538.07	7.99
36	688029	南微医学	5,342,319.03	7.53
37	00027	银河娱乐	5,219,208.95	7.36
38	06618	京东健康	5,135,542.55	7.24
39	02601	中国太保	4,832,472.14	6.81

40	02020	安踏体育	4,501,017.04	6.35
41	002594	比亚迪	4,485,373.15	6.32
42	01177	中国生物制药	4,480,587.19	6.32
43	02331	李宁	4,458,610.15	6.29
44	300896	爱美客	4,405,358.81	6.21
45	01548	金斯瑞生物科技	4,268,423.72	6.02
46	00522	ASM PACIFIC	4,207,792.61	5.93
47	01347	华虹半导体	4,149,746.35	5.85
48	02313	申洲国际	4,125,440.72	5.82
49	300760	迈瑞医疗	4,093,825.00	5.77
50	02333	长城汽车	4,057,019.09	5.72
51	01999	敏华控股	4,054,830.77	5.72
52	01521	方达控股	3,924,734.58	5.53
53	600521	华海药业	3,905,284.52	5.51
54	01833	平安好医生	3,842,126.59	5.42
55	600276	恒瑞医药	3,765,569.30	5.31
56	09996	沛嘉医疗-B	3,672,062.42	5.18
57	00168	青岛啤酒股份	3,660,268.29	5.16
58	06862	海底捞	3,418,703.39	4.82
59	01877	君实生物	3,304,147.49	4.66
60	01579	颐海国际	3,267,590.23	4.61
61	600519	贵州茅台	3,252,829.05	4.59
62	01117	现代牧业	3,199,132.21	4.51
63	600763	通策医疗	3,074,045.20	4.33
64	02096	先声药业	3,067,571.79	4.32
65	02382	舜宇光学科技	3,050,395.32	4.30
66	03898	时代电气	3,021,323.59	4.26
67	603520	司太立	3,009,668.77	4.24
68	600827	百联股份	2,986,019.53	4.21
69	000516	国际医学	2,880,333.24	4.06
70	09966	康宁杰瑞制药-B	2,854,185.31	4.02
71	06865	福莱特玻璃	2,826,593.41	3.98
72	300573	兴齐眼药	2,760,179.00	3.89
73	00285	比亚迪电子	2,621,627.02	3.70
74	00241	阿里健康	2,584,695.13	3.64
75	688016	心脉医疗	2,581,058.18	3.64
76	688575	亚辉龙	2,548,162.60	3.59
77	603658	安图生物	2,439,182.00	3.44
78	000858	五粮液	2,368,016.60	3.34
79	02319	蒙牛乳业	2,340,320.15	3.30

80	688303	大全能源	2,305,383.80	3.25
81	000301	东方盛虹	2,294,944.00	3.24
82	01811	中广核新能源	2,282,484.57	3.22
83	300294	博雅生物	2,242,064.00	3.16
84	300601	康泰生物	2,191,229.00	3.09
85	603260	合盛硅业	2,070,020.80	2.92
86	600976	健民集团	1,830,168.08	2.58
87	688050	爱博医疗	1,769,161.15	2.49
88	300676	华大基因	1,704,236.00	2.40
89	301047	义翘神州	1,700,014.00	2.40
90	300280	紫天科技	1,696,055.53	2.39
91	02318	中国平安	1,678,942.08	2.37
92	601567	三星医疗	1,650,711.86	2.33
93	000650	仁和药业	1,650,619.00	2.33
94	605499	东鹏饮料	1,592,354.50	2.24
95	603456	九洲药业	1,581,104.02	2.23
96	09939	开拓药业-B	1,577,097.38	2.22
97	300015	爱尔眼科	1,542,427.00	2.17
98	002044	美年健康	1,531,706.20	2.16
99	688613	奥精医疗	1,447,612.51	2.04
100	02500	启明医疗-B	1,445,188.10	2.04
101	09633	农夫山泉	1,438,995.70	2.03

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。

#### 8.4.3 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	708,961,499.05
卖出股票收入（成交）总额	649,402,237.39

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

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。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

#### 8.12.3 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	27,190.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	29,359.08
4	应收利息	1,821.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	58,370.70

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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（%）
银华港股通精选股票发起式 A	9,584	9,297.34	10,000,200.02	11.22	79,105,528.55	88.78
银华港股通精选股票发起式 C	273	3,042.34	-	-	830,559.46	100.00
合计	9,857	9,124.10	10,000,200.02	11.12	79,936,088.01	88.88

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）。

### 9.2 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	银华港股通精选股票发起式 A	1,853,939.84	2.08
	银华港股通精选股票发起式 C	61,121.49	7.36
	合计	1,915,061.33	2.13

### 9.3 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情况

项目	份额级别	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	银华港股通精选股票发起式 A	0
	银华港股通精选股票发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华港股通精选股票发起式 A	10~50
	银华港股通精选股票发起式 C	0~10
	合计	10~50

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.02	11.12	10,000,200.02	11.12	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.02	11.12	10,000,200.02	11.12	3 年

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,000,200.02 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 200.02 份。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华港股通精选股票发起式 A	银华港股通精选股票发起式 C
基金合同生效日 (2020 年 4 月 1 日)	13,669,937.44	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	51,456,958.22	-
本报告期基金总申购份额	152,062,027.84	850,082.51
减:本报告期基金总赎回份额	114,413,257.49	19,523.05
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	89,105,728.57	830,559.46

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

#### 11.2.1 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。

#### 11.2.2 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,无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 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、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 2021 年 1 月 15 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 1 月 15 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 50,000.00 元。目前的审计机构已连续 2 年为本基金提供审计服务。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
高华证券	3	1,044,038,418.85	76.86%	835,227.94	74.60%	-
恒泰证券	1	59,239,074.64	4.36%	55,169.44	4.93%	-
国金证券	2	44,685,161.58	3.29%	41,615.38	3.72%	-
国元证券	1	38,074,512.10	2.80%	35,458.71	3.17%	-
西南证券	2	34,794,656.74	2.56%	32,404.52	2.89%	-
大同证券	1	33,166,303.21	2.44%	30,887.83	2.76%	-
第一创业	1	22,675,597.78	1.67%	21,117.91	1.89%	-
中金财富	2	21,270,460.13	1.57%	19,809.04	1.77%	-
信达证券	2	16,701,666.49	1.23%	12,213.62	1.09%	-
新时代证券	2	16,462,080.32	1.21%	12,038.81	1.08%	-
中信证券	5	15,046,643.85	1.11%	14,013.12	1.25%	撤销1个交易单元
汇丰前海证券	2	6,398,617.26	0.47%	4,679.47	0.42%	新增2个交易单元
申万宏源	2	2,748,791.54	0.20%	2,560.03	0.23%	-

川财证券	2	1,913,491.95	0.14%	1,399.43	0.12%	-
国信证券	2	1,148,260.00	0.08%	1,069.33	0.10%	-
渤海证券	3	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	新增1 个交 易单 元
财达证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	新增2 个交 易单 元
方正证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国开证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	新增2 个交 易单 元
华西证券	3	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	新增2 个交 易单 元

平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元
中银国际	1	-	-	-	-	-
财信证券	0	-	-	-	-	撤销 1 个交易单元
上海华信	0	-	-	-	-	撤销 2 个交易单元
粤开证券	0	-	-	-	-	撤销 2 个交易单元

						元
--	--	--	--	--	--	---

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。

### 11.7.2 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
高华证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	111,945.00	100.00%	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国开证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
上海华信	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金于本报告期末运用交易单元进行债券回购交易、权证交易。

### 11.8 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	2021-1-15
2	《银华港股通精选股票型发起式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	2021-1-15
3	《银华港股通精选股票型发起式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	2021-1-15
4	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同(2021年1月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-1-15

5	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金托管协议（2021 年 1 月修订）》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-1-15
6	《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	2021-1-20
7	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 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	2021-1-20
8	《银华基金管理股份有限公司关于银华港股通精选股票型发起式证券投资基金增加山西证券股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 上海证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-1-21
9	《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	2021-2-3
10	《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	2021-2-5
11	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京创金启富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, 上海证券报, 证券时报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-23
12	《银华基金管理股份有限公司关于银华港股通精选股票型发起式证券投资基金增加大同证券有限责任公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 上海证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-25
13	《银华港股通精选股票型发起式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	2021-3-23
14	《银华港股通精选股票型发起式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	2021-3-23
15	《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	2021-3-29
16	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 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	2021-3-29
17	《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	2021-3-30

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	2021-4-21
19	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 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	2021-4-21
20	《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	2021-4-27
21	《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, 三大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-14
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	2021-5-17
23	《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	2021-6-4
24	《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	2021-6-28
25	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-7-19
26	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 2021 年第 2 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	2021-7-19
27	《银华基金管理股份有限公司关于增加腾安基金销售(深圳)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	2021-7-21
28	《银华基金管理股份有限公司关于调整银华旗下部分基金在代销机构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	2021-7-23
29	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 3 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-20
30	《银华港股通精选股票型发起式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	2021-8-20

31	《银华基金管理股份有限公司关于银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理离任的公告》	本基金管理人网站, 上海证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-20
32	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2021-8-28
33	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 2021 年中期报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-28
34	《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	2021-9-14
35	《银华基金管理股份有限公司关于增加国泰君安证券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, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-22
36	《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	2021-9-27
37	《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	2021-10-12
38	《银华基金管理股份有限公司关于对旗下部分基金于 2021 年 10 月 13 日的申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务申请作无效处理的公告》	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	2021-10-13
39	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-10-26
40	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 2021 年第 3 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	2021-10-26
41	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海华夏财富投资管理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	2021-11-2
42	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金托管协议(2021 年 12 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-1
43	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同(2021 年 12 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-1
44	《银华港股通精选股票型发起式证券	本基金管理人网站, 中	2021-12-1

	投资基金基金产品资料概要更新》	中国证监会基金电子披露网站	
45	《银华港股通精选股票型发起式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	2021-12-1
46	《银华基金管理股份有限公司关于旗下银华港股通精选股票型发起式证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同的公告》	本基金管理人网站, 上海证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-1
47	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 C 类基金份额开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 上海证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-1
48	《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	2021-12-22
49	《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	2021-12-28
50	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》	本基金管理人网站, 三大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-31
51	《银华基金管理股份有限公司关于增加和耕传承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	2021-12-31
52	《银华基金管理股份有限公司关于增加玄元保险代理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	2021-12-31
53	《银华港股通精选股票型发起式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	2021-12-31
54	《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金招募说明书更新(2021 年第 5 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20210106-20210119	10,000,200.02	-	-	10,000,200.02	11.12

#### 产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50% 时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50% 的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2021 年 1 月 15 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 1 月 15 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 12 月 1 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下银华港股通精选股票型发起式证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同的公告》及《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金 C 类基金份额开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》，本基金自 2021 年 12 月 3 日起增设 C 类基金份额，同时开放日常申购、赎回及定期定额投资业务，并对基金合同、托管协议进行了相应修改。

3、本基金管理人于 2021 年 12 月 31 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》，本基金自

2021 年 12 月 31 日起可根据投资策略需要或市场环境变化,选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票,基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 银华港股通精选股票型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 13.1.2 《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金合同》
- 13.1.4 《银华港股通精选股票型发起式证券投资基金托管协议》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 13.2 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。

### 13.3 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)查阅。

银华基金管理股份有限公司

2022 年 3 月 29 日