

# 银华永盛债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：南京银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 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>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 主要财务指标和基金净值表现</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                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 13        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 13        |
| 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             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16        |
| 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       | 16        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16        |
| 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 | 17        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见       | 17        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 18        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 20        |
| 6.4 报表附注                                | 23        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>42</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43        |
| 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       | 43        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 43        |
| 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      | 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 ..... | 44        |
| 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 ..... | 44        |
| 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 .....    | 44        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 44        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 44        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 45        |
| 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情况 .....      | 45        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>45</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 46        |
| 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 .....         | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 46        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>48</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 .....    | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 49        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>49</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 49        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 49        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 49        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 银华永盛债券型证券投资基金    |
| 基金简称       | 银华永盛债券           |
| 基金主代码      | 008211           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2020 年 3 月 5 日   |
| 基金管理人      | 银华基金管理股份有限公司     |
| 基金托管人      | 南京银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 962,012,415.42 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金以债券为主要投资对象，在控制信用风险、谨慎投资的前提下，主要获取持有期收益，追求基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略   | <p>本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的结构，并通过自下而上精选债券，获取优化收益。</p> <p>本基金的投资组合比例为：债券投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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，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> <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 | 中债综合指数（全价）收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          | 基金管理人                          | 基金托管人              |
|-------------|--------------------------------|--------------------|
| 名称          | 银华基金管理股份有限公司                   | 南京银行股份有限公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                             | 杨文辉                |
|             | 联系电话                           | (010) 58163000     |
|             | 电子邮箱                           | yhjj@yhfund.com.cn |
| 客户服务电话      | 4006783333, (010) 85186558     | 95302              |
| 传真          | (010) 58163027                 | 025-86776189       |
| 注册地址        | 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层   | 江苏省南京市中山路 288 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 | 江苏省南京市中山路 288 号    |
| 邮政编码        | 100738                         | 210008             |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 王珠林 | 胡升荣 |
|-------|-----|-----|

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年1月1日-2022年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 16,229,587.61             |
| 本期利润          | 16,937,796.38             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0176                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.67%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.68%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | 59,188,394.28             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0615                    |
| 期末基金资产净值      | 1,024,061,490.19          |
| 期末基金份额净值      | 1.0645                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2022年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 6.45%                     |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

### 3.2 基金净值表现

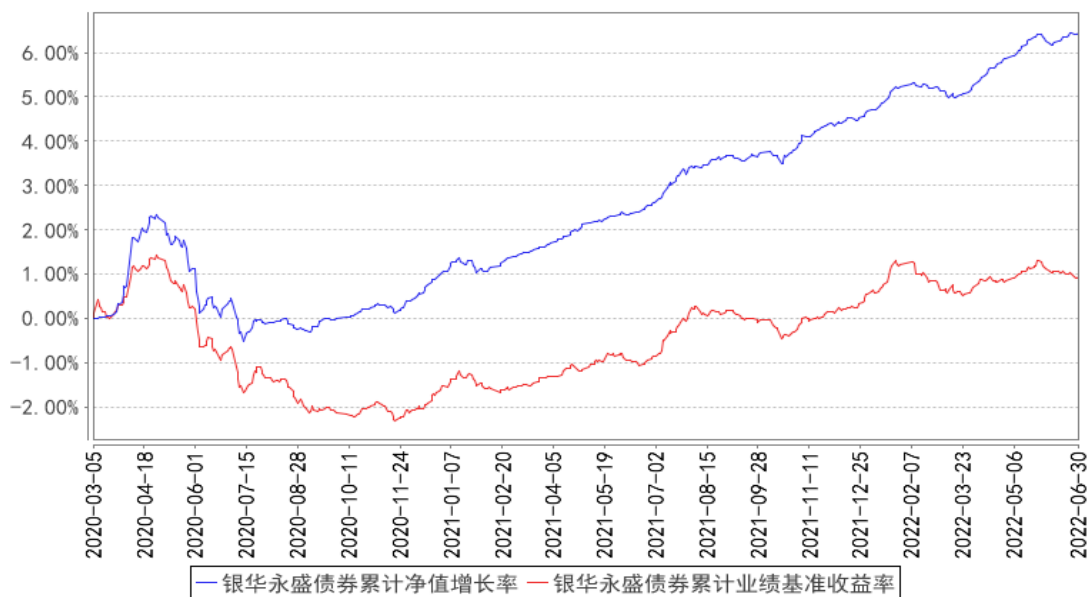
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率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      | 0.10% | 0.03% | -0.24% | 0.03% | 0.34% | 0.00%  |
| 过去三个月      | 1.18% | 0.03% | 0.29%  | 0.04% | 0.89% | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.68% | 0.03% | 0.38%  | 0.05% | 1.30% | -0.02% |
| 过去一年       | 3.73% | 0.04% | 1.83%  | 0.05% | 1.90% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.45% | 0.07% | 0.95%  | 0.07% | 5.50% | 0.00%  |

### 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

银华永盛债券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：债券投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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，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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 174 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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（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、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医

药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰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发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业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            |        |   |
| 李丹女士 | 本基金的基金经理 | 2022 年 1 月 26 日 | -               | 8.5 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。自 2020 年 10 月 20 日至 2021 年 10 月 18 日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 日至 2022 年 1 月 25 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 2021 年 3 月 24 日起兼任银华信用四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，自 2022 年 1 月 26 日兼任银华永盛债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 瞿灿女士 | 本基金的基金经理 | 2020 年 3 月 5 日  | 2022 年 3 月 11 日 | 10.5 年 | 硕士学位。2011 年至 2013 年任职于安信证券研究所；2013 年加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员、基金经理助理职务。自 2015 年 5 月 25 日至 2017 年 7 月 13 日担任银华永益分级债券型证券投资基   |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>金基金经理，自 2015 年 5 月 25 日至 2016 年 1 月 17 日兼任银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 18 日至 2022 年 3 月 8 日兼任银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金（LOF）基金经理，自 2016 年 2 月 15 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，自 2016 年 3 月 18 日至 2018 年 8 月 22 日兼任银华合利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 6 日至 2019 年 3 月 2 日兼任银华双动力债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月 17 日至 2020 年 6 月 1 日兼任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理，自 2018 年 6 月 27 日至 2020 年 1 月 18 日兼任银华中证 5 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证 10 年期地方政府债指数证券投资基金基金经理，自 2018 年 6 月 27 日至 2020 年 4 月 2 日兼任银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金基金经理，自 2018 年 6 月 27 日至 2020 年 11 月 4 日兼任银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金基金经理，自 2018 年 6 月 27 日至 2020 年 9 月 11 日兼任银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金基金经理，自 2018 年 12 月 7 日至 2019 年 12 月 18 日兼任银华安盈短债债券型证券投资基金基金经理，自 2019 年 2 月 13 日至 2020 年 2 月 17 日兼任银华安鑫短债债券型证券投资基金基金经理，自 2019 年 3 月 14 日至 2020 年 8 月 5 日兼任银华安享短债债券型证券投资基金基金经理，自 2019 年 8 月 21 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 2020 年 3 月 5 日至 2022 年 3 月 11 日兼任银华永盛债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 12 月 23 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华长江经济带主题债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 24 日起兼任银华添润定期开放债券型证券投资基金及银华添益定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 23 日起兼任银华岁丰定期开放债券</p> |
|--|--|--|--|--|

|                 |                    |                        |   |       |   |
|-----------------|--------------------|------------------------|---|-------|---|
|                 |                    |                        |   |       | 型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 11 月 26 日起兼任银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 2 日起兼任银华永丰债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |
| 魏 晟<br>峻 先<br>生 | 本基金的<br>基金经理<br>助理 | 2020 年 3<br>月 5 日      | - | 8.5 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。                            |
| 杨 沐<br>阳 先<br>生 | 本基金的<br>基金经理<br>助理 | 2020 年 8<br>月 12 日     | - | 5.0 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。                       |
| 陈 皓<br>原 女<br>士 | 本基金的<br>基金经理<br>助理 | 2021 年 7<br>月 14 日     | - | 5.5 年 | 硕士学位。2016 年 3 月加入银华基金，历任投资管理三部固收研究部助理信用研究员、信用研究员，现任投资管理三部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。                                   |
| 朱 仲<br>华 先<br>生 | 本基金的<br>基金经理<br>助理 | 2021 年<br>11 月 19<br>日 | - | 8 年   | 硕士学位。曾就职于西南证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、中国光大银行股份有限公司。2021 年 11 月加入银华基金，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、《银华永盛债券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两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。

#### 4.3.2 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不存在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。

### 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

2022 年上半年，经济走势较为波折，受疫情影响较大。2022 年一季度和二季度 GDP 增速分别为 4.8% 和 0.4%。如果观察制造业 PMI 指数，1-6 月读数分别为 50.1、50.2、49.5、47.4、49.6、50.2，呈现为先小幅上行、再大幅下降、再回升的走势。上半年经济运行大体可以分为三个阶段。首先，1-2 月间，在中央经济工作会议“政策发力适当靠前”的要求下，货币信贷、财政等宏观政策均有所发力，宏观经济形势相应出现一定积极变化，投资、消费等内需增速较 2021 年末上升。然而，3 月至 4 月，全国出现一轮大面积的疫情反复，并且一度对物流和供应链产生扰动，显著影响了经济运行。5 月至 6 月，全国疫情形势趋向改善，政策层着力缓解物流梗阻并推动复工复产，同时通过实施大规模留抵退税、加快专项债发行、引导加大信贷投放力度、调整地产需求端政策等方式发力稳增长，经济逐渐得到修复。从生产端数据看，2022 年上半年工业增加值累计同比 3.4%，服务业生产指数累计同比-0.4%，服务业表现对疫情更为敏感。从需求端看，上半年固定资产投资累计同比 6.1%，其中制造业、基建、地产投资分别为 10.4%、9.3%、-5.4%，地产是主要的拖累因素；上半年社会消费品零售总额累计同比-0.7%，疫情造成消费场景受限，以及就业形势恶化、居民收入增长放缓、消费倾向下降，都制约了消费表现；上半年美元计价的出口累计同比 14.2%，海外通胀高企反映出海外供需偏紧，对我国出口保持了较强拉动。物价方面，2022 年上半年 CPI 累计同比 1.7%，食品项同比跌幅收窄，带动整体读数有所回升，但仍处于较温和的水平；核心 CPI 累计同比 1%，内需偏弱仍然对核心通胀形成压制；PPI 累计同比 7.7%，在基数因素作用下逐渐走低。

2022 年上半年，债券收益率经历多轮波动，在经济走势本身较为波折的背景下，还叠加了资金面和机构行为的影响。1 月，央行调降公开市场操作利率 10bp，催化债券收益率出现一轮下行。春节假期后，随着公布 1 月金融数据超预期、多地出现地产政策放松消息，市场对信用扩张和经济回暖的预期上升，债券收益率出现回升。2 月下旬俄乌冲突爆发，3 月上半月资本市场大幅波动

并形成负反馈压力，债券市场也出现一定抛压，债券收益率进一步走升。3 月下旬，国内疫情影响发酵，并且自 4 月开始银行间资金面持续处于高度宽松状态，4 月至 5 月间债券收益率陡峭化下行。自 5 月末至 6 月，随着疫情形势缓解、上海解封并全面推动复工复产、地产高频数据回暖，市场风险偏好得到提升，债券收益率回升。总体来看，上半年短端收益率在宽松资金面带动下有所下行，而中长端收益率呈震荡走势、涨跌互现。利率债方面，短端的 1 年国债收益率 29bp 至 1.95%，1 年国开债收益率下行 30bp 至 2.02%；长端的 10 年国债收益率上行 5bp 至 2.82%，10 年国开债收益率下行 3bp 至 3.05%；信用债方面，1、3、5 年 AAA 中票收益率分别下行 33bp、上行 4bp、上行 6bp，1、3、5 年 AA+中票收益率分别下行 34bp、1bp、3bp，1、3、5 年 AA 中票收益率分别下行 38bp、35bp、15bp，信用债等级利差压缩。上半年，本基金在债券配置上采取中性久期、适度杠杆的票息策略，根据市场变化不断优化持仓结构，并始终严格控制信用风险敞口。

下半年，宏观经济进入疫情扰动后的修复期。目前来看，基建仍是稳增长的主要抓手，政策层通过调增政策性银行 8000 亿元信贷额度、运用政策性和开发性金融工具筹资 3000 亿元用于补充重大项目资本金或为专项债项目资本金搭桥、提前储备 2023 年专项债项目等方式不断提升对基建端的支持力度。而地产链条的走势也进入政策放松后的重要观察期，在 4 月 29 日政治局会议提出“支持各地从当地实际出发完善房地产政策，支持刚性和改善性住房需求”的背景下，5 月以来地产政策出现较为实质性的放松。从高频数据观察，6 月以来 30 大中城市商品房成交数据增速出现回升，一定程度上反映出了地产政策放松的效果，但受到居民收入增速放缓、民企地产企业信用风险事件频发等因素影响，地产销售反弹的高度仍存在不确定。后续需要通过信贷社融数据、建筑业链条高频数据等多方面对其表现进行交叉验证。短期来看，在复工复产和宽松政策环境的作用下，经济修复是大概率事件。不过与 2020 年疫后复苏相比，经济修复的高度可能面临至少两大制约因素。一是疫情反复的风险难以完全消除。二是外需回落压力可能逐渐显现。随着美联储坚决加息以遏制通胀，美国金融条件快速收紧，经济动能开始走弱，中美经济周期的错位增加了下半年经济复苏的不确定性。货币政策有望维持偏宽松环境，但暂难形成增量利好。在前期构成较大规模流动性供给的留抵退税因素结束后，货币当局的态度和货币政策的操作对金融市场流动性的影响程度将上升，资金面面临的潜在波动或有所增加。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0645 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.68%，业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年债券市场，我们认为把握票息确定性的同时，需要适度采取逆向思维，在波动中

寻找机会。相比于 2020 年，2022 年的债券收益率波动区间较窄，可能存在多方面原因：一是货币政策相对克制；二是市场对于稳增长政策的空间和效果始终存在预期，对于 2020 年行情反转的记忆深刻，因此持续处于“短多长空”的心态，收益率曲线陡峭化显著，多数 3 年以上债券品种今年以来收益率并未下行；三是政策需要兼顾稳增长和防风险等多方面，国内外政策和经济周期也存在错位，使得基本面形势较为复杂。策略上，本基金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。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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，南京银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。



## 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

本报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期未进行利润分配。

## 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

本托管人复核审查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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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。

# § 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：银华永盛债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 1,600,678.97           | 5,989,704.19             |
| 结算备付金      |         | 3,036,087.86           | -                        |
| 存出保证金      |         | 38,453.01              | -                        |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 1,215,804,563.82       | 963,848,000.00           |
| 其中：股票投资    |         | -                      | -                        |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 1,215,804,563.82       | 963,848,000.00           |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                      | 24,972,265.46            |
| 债权投资       | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资    |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资     | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资   | 6.4.7.7 | -                      | -                        |
| 应收清算款      |         | -                      | -                        |
| 应收股利       |         | -                      | -                        |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收申购款         |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | 12,790,228.70               |
| 资产总计          |            | 1,220,479,783.66          | 1,007,600,198.35            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021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     |            | 195,737,525.40            | -                           |
| 应付清算款         |            | 100,119.77                | -                           |
| 应付赎回款         |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 252,179.99                | 199,253.27                  |
| 应付托管费         |            | 84,060.00                 | 66,417.74                   |
| 应付销售服务费       |            | -                         | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 60,693.45                 | 7,459.91                    |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 183,714.86                | 212,724.98                  |
| 负债合计          |            | 196,418,293.47            | 485,855.90                  |
| <b>净资产:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 962,012,415.42            | 962,003,369.91              |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 62,049,074.77             | 45,110,972.54               |
| 净资产合计         |            | 1,024,061,490.19          | 1,007,114,342.45            |
| 负债和净资产总计      |            | 1,220,479,783.66          | 1,007,600,198.35            |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0645 元，基金份额总额 962,012,415.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华永盛债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目             | 附注号      | 本期                                 | 上年度可比期间                            |
|----------------|----------|------------------------------------|------------------------------------|
|                |          | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 |
| <b>一、营业总收入</b> |          | 21,154,736.24                      | 10,711,003.57                      |
| 1. 利息收入        |          | 39,394.64                          | 9,490,399.65                       |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.13 | 35,899.25                          | 8,663.99                           |
| 债券利息收入         |          | -                                  | 9,479,515.80                       |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 资产支持证券利息收入                 |            | -             | -            |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 3,495.39      | 2,219.86     |
| 证券出借利息收入                   |            | -             | -            |
| 其他利息收入                     |            | -             | -            |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 20,407,117.82 | -956,038.11  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | -             | -            |
| 基金投资收益                     |            | -             | -            |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15   | 20,407,117.82 | -956,038.11  |
| 资产支持证券投资                   | 6.4.7.16   | -             | -            |
| 收益                         |            |               |              |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17   | -             | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18   | -             | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.19   | -             | -            |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -             | -            |
| 其他投资收益                     |            | -             | -            |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.20   | 708,208.77    | 2,176,638.11 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -             | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.21   | 15.01         | 3.92         |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 4,216,939.86  | 1,923,572.33 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,510,653.05  | 869,524.57   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 503,551.03    | 289,841.56   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -             | -            |
| 4. 投资顾问费                   |            | -             | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 2,048,662.78  | 637,796.05   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 2,048,662.78  | 637,796.05   |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -             | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | 46,212.85     | -            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 107,860.15    | 126,410.15   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 16,937,796.38 | 8,787,431.24 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 16,937,796.38 | 8,787,431.24 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 16,937,796.38 | 8,787,431.24 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华永盛债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |               |                  |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|---------------|------------------|
|                                     | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 962,003,369.91                        | -      | 45,110,972.54 | 1,007,114,342.45 |
| 加：会计政策变更                            | -                                     | -      | -             | -                |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -             | -                |
| 其他                                  | -                                     | -      | -             | -                |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                     | 962,003,369.91                        | -      | 45,110,972.54 | 1,007,114,342.45 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | 9,045.51                              | -      | 16,938,102.23 | 16,947,147.74    |
| (一)、综合收益总额                          | -                                     | -      | 16,937,796.38 | 16,937,796.38    |
| (二)、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) | 9,045.51                              | -      | 305.85        | 9,351.36         |
| 其中：1. 基金申                           | 42,357.47                             | -      | 2,342.10      | 44,699.57        |

|  |                                 |        |               |                  |
|--|---------------------------------|--------|---------------|------------------|
| 购款                                       |                                 |        |               |                  |
| 2. 基金赎回款                                 | -33,311.96                      | -      | -2,036.25     | -35,348.21       |
| (三)、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) | -                               | -      | -             | -                |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                               | -      | -             | -                |
| 四、本期末净资产(基金净值)                           | 962,012,415.42                  | -      | 62,049,074.77 | 1,024,061,490.19 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |        |               |                  |
|  | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                          | 590,047,808.65                  | -      | 6,391,049.98  | 596,438,858.63   |
| 加:会计政策变更                                 | -                               | -      | -             | -                |
| 前期差错更正                                   | -                               | -      | -             | -                |
| 其他                                       | -                               | -      | -             | -                |
| 二、本期期初净资产(基金净值)                          | 590,047,808.65                  | -      | 6,391,049.98  | 596,438,858.63   |

|  |                 |   |               |                 |
|--|-----------------|---|---------------|-----------------|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -100,011,866.53 | - | 6,437,159.50  | -93,574,707.03  |
| (一)、综合收益总额                               | -               | - | 8,787,431.24  | 8,787,431.24    |
| (二)、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)      | -100,011,866.53 | - | -2,350,271.74 | -102,362,138.27 |
| 其中:1.基金申购款                               | 1,787.84        | - | 40.66         | 1,828.50        |
| 2.基金赎回款                                  | -100,013,654.37 | - | -2,350,312.40 | -102,363,966.77 |
| (三)、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) | -               | - | -             | -               |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -               | - | -             | -               |
| 四、本期末净资产(基                               | 490,035,942.12  | - | 12,828,209.48 | 502,864,151.60  |

|      |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|
| 金净值) |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华永盛债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1978 号《关于准予银华永盛债券型证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于 2020 年 2 月 27 日至 2020 年 2 月 28 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2020）验字第 61329181\_A02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 3 月 5 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时银华永盛债券基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 990,030,127.72 元，折合 990,030,127.72 份银华永盛债券基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 56,001.05 元，折合 56,001.05 份银华永盛债券基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 990,086,128.77 元，折合 990,086,128.77 份银华永盛债券基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为南京银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行的金融工具，包括债券（国债、央行票据、政策性金融债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、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固定收益类金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接从二级市场买入股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。本基金的投资组合比例为：债券投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。业绩比较基准：中债综合指数（全价）收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。



划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且

符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息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，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产

生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,989,704.19 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 75,286.04 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,064,990.23 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

24,972,265.46 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,165.13 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 24,973,430.59 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,790,228.70 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 75,286.04 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 12,713,777.53 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 1,165.13 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 963,848,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 12,713,777.53 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 976,561,777.53 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,600,678.97           |
| 等于：本金          | 1,600,383.45           |
| 加：应计利息         | 295.52                 |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 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           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 1,600,678.97           |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |                  |               |                  |              |
|---------------|------------------------|------------------|---------------|------------------|--------------|
|               | 成本                     | 应计利息             | 公允价值          | 公允价值变动           |              |
| 股票            | -                      | -                | -             | -                |              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -                | -             | -                |              |
| 债券            | 交易所市场                  | 181,502,335.89   | 2,248,473.43  | 184,047,473.43   | 296,664.11   |
|               | 银行间市场                  | 1,013,966,927.55 | 16,237,090.39 | 1,031,757,090.39 | 1,553,072.45 |
|               | 合计                     | 1,195,469,263.44 | 18,485,563.82 | 1,215,804,563.82 | 1,849,736.56 |

|        |                  |               |                  |              |
|--------|------------------|---------------|------------------|--------------|
| 资产支持证券 | -                | -             | -                | -            |
| 基金     | -                | -             | -                | -            |
| 其他     | -                | -             | -                | -            |
| 合计     | 1,195,469,263.44 | 18,485,563.82 | 1,215,804,563.82 | 1,849,736.56 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 6.4.7.5 债权投资

注：无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 34,454.71         |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | 34,454.71         |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 149,260.15        |
| 合计          | 183,714.86        |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 962,003,369.91             | 962,003,369.91 |
| 本期申购          | 42,357.47                  | 42,357.47      |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -33,311.96                 | -33,311.96     |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 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           | 962,012,415.42 | 962,012,415.42 |

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。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 本期期初           | 42,958,441.21 | 2,152,531.33 | 45,110,972.54 |
| 本期利润           | 16,229,587.61 | 708,208.77   | 16,937,796.38 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 365.46        | -59.61       | 305.85        |
| 其中：基金申购款       | 2,266.68      | 75.42        | 2,342.10      |
| 基金赎回款          | -1,901.22     | -135.03      | -2,036.25     |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | 59,188,394.28 | 2,860,680.49 | 62,049,074.77 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 11,074.22                  |
| 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 | 24,669.33                  |
| 其他        | 155.70                     |
| 合计        | 35,899.25                  |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 20,097,216.12              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 309,901.70                 |



|                |               |
|----------------|---------------|
| 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             | 20,407,117.82 |

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,138,666,113.35     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,124,270,855.24     |
| 减：应计利息总额               | 14,067,092.40        |
| 减：交易费用                 | 18,264.01            |
| 买卖债券差价收入               | 309,901.70           |

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.19 股利收益

注：无。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 708,208.77           |
| 股票投资       | -                    |
| 债券投资       | 708,208.77           |
| 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                     | 708,208.77 |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 15.01                      |
| 合计      | 15.01                      |

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 账户维护费   | 18,600.00                  |
| 合计      | 107,860.15                 |

#### 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

无。

##### 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、基金销售机构 |
| 南京银行股份有限公司（“南京银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,510,653.05                             | 869,524.57                                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -  | -   |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 503,551.03                               | 289,841.56                                    |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

注：无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目                        | 本期                   | 上年度可比期间              |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
|                           | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 基金合同生效日（2020年3月5日）持有的基金份额 | -                    | -                    |
| 报告期初持有的基金份额               | 4,785,105.77         | -                    |
| 报告期内申购/买入总份额              | -                    | -                    |
| 报告期内因拆分变动份额               | -                    | -                    |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额            | -                    | -                    |
| 报告期末持有的基金份额               | 4,785,105.77         | -                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例       | 0.50%                | -                    |

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

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                   |           | 上年度可比期间              |          |
|-------|----------------------|-----------|----------------------|----------|
|       | 2022年1月1日至2022年6月30日 |           | 2021年1月1日至2021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   |
| 南京银行  | 1,600,678.97         | 11,074.22 | 780,974.99           | 8,663.85 |

**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(2022 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

注：无。

##### 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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 195,037,525.40 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称                 | 回购到期日             | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|----------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 102000240 | 20 南航股<br>MTN005     | 2022 年 7 月 1<br>日 | 101.87 | 34,000    | 3,463,522.43   |
| 102001391 | 20 北京国<br>资 MTN002   | 2022 年 7 月 1<br>日 | 104.43 | 300,000   | 31,330,195.07  |
| 102001805 | 20 深投控<br>MTN002     | 2022 年 7 月 1<br>日 | 104.33 | 100,000   | 10,432,741.92  |
| 102100807 | 21 光明<br>MTN001      | 2022 年 7 月 1<br>日 | 101.83 | 198,000   | 20,161,672.77  |
| 210312    | 21 进出 12             | 2022 年 7 月 1<br>日 | 101.67 | 324,000   | 32,940,369.86  |
| 101656010 | 16 苏园建<br>MTN001A    | 2022 年 7 月 4<br>日 | 102.23 | 85,000    | 8,689,266.36   |
| 101801234 | 18 新盛建<br>设 MTN004   | 2022 年 7 月 4<br>日 | 106.55 | 200,000   | 21,309,212.05  |
| 102002055 | 20 赣铁投<br>MTN002     | 2022 年 7 月 4<br>日 | 104.14 | 400,000   | 41,657,457.53  |
| 2028015   | 20 兴业银<br>行小微债<br>01 | 2022 年 7 月 5<br>日 | 100.18 | 418,000   | 41,873,712.29  |
| 合计        |                      |                   |        | 2,059,000 | 211,858,150.28 |

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 700,000.00 元，截至 2022 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 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<br>2022 年 6 月 30 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年以上 | 不计息        | 合计               |
|------------------------|----------------|----------------|-------|------------|------------------|
| 资产                     |                |                |       |            |                  |
| 银行存款                   | 1,600,678.97   | -              | -     | -          | 1,600,678.97     |
| 结算备付金                  | 3,036,087.86   | -              | -     | -          | 3,036,087.86     |
| 存出保证金                  | 38,453.01      | -              | -     | -          | 38,453.01        |
| 交易性金融资产                | 249,564,479.45 | 966,240,084.37 | -     | -          | 1,215,804,563.82 |
| 资产总计                   | 254,239,699.29 | 966,240,084.37 | -     | -          | 1,220,479,783.66 |
| 负债                     |                |                |       |            |                  |
| 应付管理人报酬                | -              | -              | -     | 252,179.99 | 252,179.99       |
| 应付托管费                  | -              | -              | -     | 84,060.00  | 84,060.00        |
| 应付清算款                  | -              | -              | -     | 100,119.77 | 100,119.77       |
| 卖出回购金融资产款              | 195,737,525.40 | -              | -     | -          | 195,737,525.40   |

|                          |                |                |                |               |                  |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 应交税费                     | -              | -              | -              | 60,693.45     | 60,693.45        |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | 183,714.86    | 183,714.86       |
| 负债总计                     | 195,737,525.40 | -              | -              | 680,768.07    | 196,418,293.47   |
| 利率敏感度缺口                  | 58,502,173.89  | 966,240,084.37 | -              | -680,768.07   | 1,024,061,490.19 |
| 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年以上          | 不计息           | 合计               |
| 资产                       |                |                |                |               |                  |
| 银行存款                     | 5,989,704.19   | -              | -              | -             | 5,989,704.19     |
| 交易性金融资产                  | 109,951,000.00 | 618,395,000.00 | 235,502,000.00 | -             | 963,848,000.00   |
| 买入返售金融资产                 | 24,972,265.46  | -              | -              | -             | 24,972,265.46    |
| 其他资产                     | -              | -              | -              | 12,790,228.70 | 12,790,228.70    |
| 资产总计                     | 140,912,969.65 | 618,395,000.00 | 235,502,000.00 | 12,790,228.70 | 1,007,600,198.35 |
| 负债                       |                |                |                |               |                  |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -              | 199,253.27    | 199,253.27       |
| 应付托管费                    | -              | -              | -              | 66,417.74     | 66,417.74        |
| 应交税费                     | -              | -              | -              | 7,459.91      | 7,459.91         |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | 212,724.98    | 212,724.98       |
| 负债总计                     | -              | -              | -              | 485,855.90    | 485,855.90       |
| 利率敏感度缺口                  | 140,912,969.65 | 618,395,000.00 | 235,502,000.00 | 12,304,372.80 | 1,007,114,342.45 |

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；  |                        |               |
| 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（2022 年 6 月 30 日）             | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |               |
| 分析        | +25 个基点                          | -7,314,963.64          | -6,801,274.25 |
|           | -25 个基点                          | 7,314,963.64           | 6,801,274.25  |

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要



求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年6月30日 |               | 上年度末<br>2021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  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 1,215,804,563.82  | 118.72        | 963,848,000.00      | 95.70         |
| 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            | 1,215,804,563.82  | 118.72        | 963,848,000.00      | 95.70         |

#### 6.4.13.4.2.2 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 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
|               |                   |                     |

|      |                  |                |
|------|------------------|----------------|
| 第一层次 |                  | -              |
| 第二层次 | 1,215,804,563.82 | 963,848,000.00 |
| 第三层次 |                  | -              |
| 合计   | 1,215,804,563.82 | 963,848,000.00 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券，若不存在活跃市场未经调整的报价（包括重大事项、新发未上市等原因所致），本基金不会于此期间将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 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              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,215,804,563.82 | 99.62         |
|    | 其中：债券             | 1,215,804,563.82 | 99.62         |
|    | 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 | 4,636,766.83     | 0.38   |
| 8 | 其他各项资产       | 38,453.01        | 0.00   |
| 9 | 合计           | 1,220,479,783.66 | 100.00 |

## 7.2 报告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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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

注：本基金本报告期内未进行股票投资。。

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

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

## 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      | 351,945,786.84   | 34.37         |
|    | 其中：政策性金融债 | 61,000,684.93    | 5.96          |
| 4  | 企业债券      | 185,665,478.91   | 18.13         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -             |
| 6  | 中期票据      | 580,110,206.56   | 56.65         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | 98,083,091.51    | 9.58          |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 1,215,804,563.82 | 118.72        |

## 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  | 112214056 | 22 江苏银行 | 1,000,000 | 98,083,091.51 | 9.58          |

|   |           |                  |         |               |      |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|------|
|   |           | CD056            |         |               |      |
| 2 | 210312    | 21 进出 12         | 600,000 | 61,000,684.93 | 5.96 |
| 3 | 101800854 | 18 豫交投<br>MTN002 | 500,000 | 52,891,427.40 | 5.16 |
| 4 | 2080258   | 20 郑发投资债<br>01   | 500,000 | 52,366,791.78 | 5.11 |
| 5 | 2128039   | 21 中国银行二级<br>03  | 500,000 | 51,520,561.64 | 5.03 |

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.11 投资组合报告附注

##### 7.11.1 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。

##### 7.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票，因此本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

##### 7.11.3 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 | 38,453.01 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | -         |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 38,453.01 |

**7.11.4 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。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

**7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>(%) | 持有份额      | 占总份额比例<br>(%) |
| 207          | 4,647,402.97  | 961,996,745.47 | 100.00        | 15,669.95 | 0.00          |

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 10.00      | 0.00         |

**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

|                              |                |
|------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2020年3月5日)基<br>金份额总额 | 990,086,128.77 |
| 本报告期期初基金份额总额                 | 962,003,369.91 |
| 本报告期基金总申购份额                  | 42,357.47      |
| 减：本报告期基金总赎回份额                | 33,311.96      |
| 本报告期基金拆分变动份额                 | -              |
| 本报告期末基金份额总额                  | 962,012,415.42 |

注：如有相应情况，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

2022 年 3 月 1 日，本基金管理人发布关于首席信息官任职的公告，经本基金管理人董事会批准，张轶先生自 2022 年 2 月 28 日起担任本基金管理人首席信息官职务。

#### 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，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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本年度未变更会计师事务所。

### 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 (%) |    |
| 平安证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

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 (%) |
| 平安证券 | 212,656,400.00 | 100.00           | 3,657,800,000.00 | 100.00             | -    | -                |

### 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  | 《银华永盛债券型证券投资基金 2021 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        | 2022 年 01 月 21 日 |
| 2  | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告》              | 四大证券报                          | 2022 年 01 月 21 日 |
| 3  | 《银华永盛债券型证券投资基金招募说明书更新(2022 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        | 2022 年 01 月 28 日 |
| 4  | 《银华永盛债券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        | 2022 年 01 月 28 日 |
| 5  | 《银华基金管理股份有限公司关于银华永盛债券型证券投资基金增聘基金经理的公告》                | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报 | 2022 年 01 月 28 日 |
| 6  | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告》 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报 | 2022 年 02 月 15 日 |
| 7  | 《银华永盛债券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        | 2022 年 02 月 24 日 |
| 8  | 《银华永盛债券型证券投资基金招募说明书更新(2022 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        | 2022 年 02 月 24 日 |
| 9  | 《银华基金管理股份有限公司关于银华永盛债券型证券投资基金基金经理离任的公告》                | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报 | 2022 年 03 月 12 日 |
| 10 | 《银华永盛债券型证券投资基金招募说明书更新(2022 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        | 2022 年 03 月 14 日 |

|    |  |                                |                  |
|----|--|--------------------------------|------------------|
| 11 | 《银华永盛债券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        | 2022 年 03 月 14 日 |
| 12 | 《银华永盛债券型证券投资基金 2021 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        | 2022 年 03 月 29 日 |
| 13 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告》       | 四大证券报                          | 2022 年 03 月 29 日 |
| 14 | 《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报 | 2022 年 04 月 18 日 |
| 15 | 《银华永盛债券型证券投资基金 2022 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        | 2022 年 04 月 20 日 |
| 16 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告》   | 四大证券报                          | 2022 年 04 月 20 日 |
| 17 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为代销机构的公告》 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报 | 2022 年 04 月 26 日 |
| 18 | 《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为代销机构的公告》 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报 | 2022 年 05 月 11 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |          |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|----------|
|       | 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              | 20220101-20220630       | 957,211,639.70 | 0.00 | 0.00 | 957,211,639.70 | 99.50    |

#### 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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华永盛债券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 《银华永盛债券型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华永盛债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华永盛债券型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2022 年 8 月 29 日

