

# 银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2022 年年度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 29 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 2022 年 01 月 01 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                              | 5         |
| 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                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 8         |
| <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              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 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             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16        |
| 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       | 16        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17        |
| 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 17        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 19        |
| 7.2 利润表                                 | 20        |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表                        | 22        |
| 7.4 报表附注                                | 25        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>52</b> |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 52        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 52        |
| 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 .....     | 54        |
| 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 .....                  | 58        |
| 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 .....    | 58        |
| 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 ..... | 58        |
| 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 ..... | 58        |
| 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 .....    | 58        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 58        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 58        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 58        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>59</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 59        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 59        |
| 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 .....      | 59        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>59</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>60</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 60        |
| 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 .....      | 60        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 60        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 60        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 61        |
| 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 .....         | 61        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 61        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 66        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>68</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 .....    | 68        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 68        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>68</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 68        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 68        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 68        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 |
| 基金简称       | 银华-道琼斯 88 指数       |
| 基金主代码      | 180003             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2004 年 8 月 11 日    |
| 基金管理人      | 银华基金管理股份有限公司       |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,123,295,095.98 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金将运用增强型指数化投资方法，通过严格的投资流程和数量化风险管理，在对标的指数有效跟踪的基础上力求取得高于指数的投资收益率，实现基金资产的长期增值。   |
| 投资策略   | 本基金为增强型指数基金，以道琼斯中国 88 指数为基金投资组合跟踪的标的指数，股票指数化投资部分主要投资于标的指数的成份股票，增强部分主要选择基本面好、具有核心竞争力的价值型企业的股票，在控制与标的指数偏离风险的前提下，力求取得超越标的指数的投资收益率。<br>本基金将不高于 95% 的资产投资于股票，且保持不低于基金资产 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。 |
| 业绩比较基准 | 道琼斯中国 88 指数收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，其预期收益与预期风险高于债券型基金与货币市场基金。  |

### 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                   | 中国建设银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                             | 王小飞                    |
|             | 联系电话                           | 021-60637103           |
|             | 电子邮箱                           | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      | 4006783333, (010)85186558      | 021-60637228           |
| 传真          | (010)58163027                  | 021-60635778           |
| 注册地址        | 广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层   | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼  |
| 邮政编码        | 100738                         | 100033                 |
| 法定代表人       | 王珠林                            | 田国立                    |

### 2.4 信息披露方式

|                |        |
|----------------|--------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
|----------------|--------|

|                     |                          |
|---------------------|--------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.yhfund.com.cn |
| 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 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室 |
| 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 | 2022 年           | 2021 年           | 2020 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | -137,168,963.61  | 596,247,771.36   | 470,784,115.27   |
| 本期利润          | -549,801,478.37  | 48,558,324.59    | 974,677,678.14   |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.4714          | 0.0410           | 0.6837           |
| 本期加权平均净值利润率   | -36.12%          | 2.22%            | 46.75%           |
| 本期基金份额净值增长率   | -26.34%          | 0.85%            | 54.91%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022 年末          | 2021 年末          | 2020 年末          |
| 期末可供分配利润      | 217,213,508.09   | 877,353,365.00   | 834,040,576.75   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1934           | 0.6201           | 0.5445           |
| 期末基金资产净值      | 1,340,508,604.07 | 2,292,132,186.89 | 2,760,381,867.71 |
| 期末基金份额净值      | 1.1934           | 1.6201           | 1.8022           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2022 年末          | 2021 年末          | 2020 年末          |
| 基金份额          | 543.99%          | 774.25%          | 766.87%          |

|         |  |  |  |
|---------|--|--|--|
| 累计净值增长率 |  |  |  |
|---------|--|--|--|

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认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

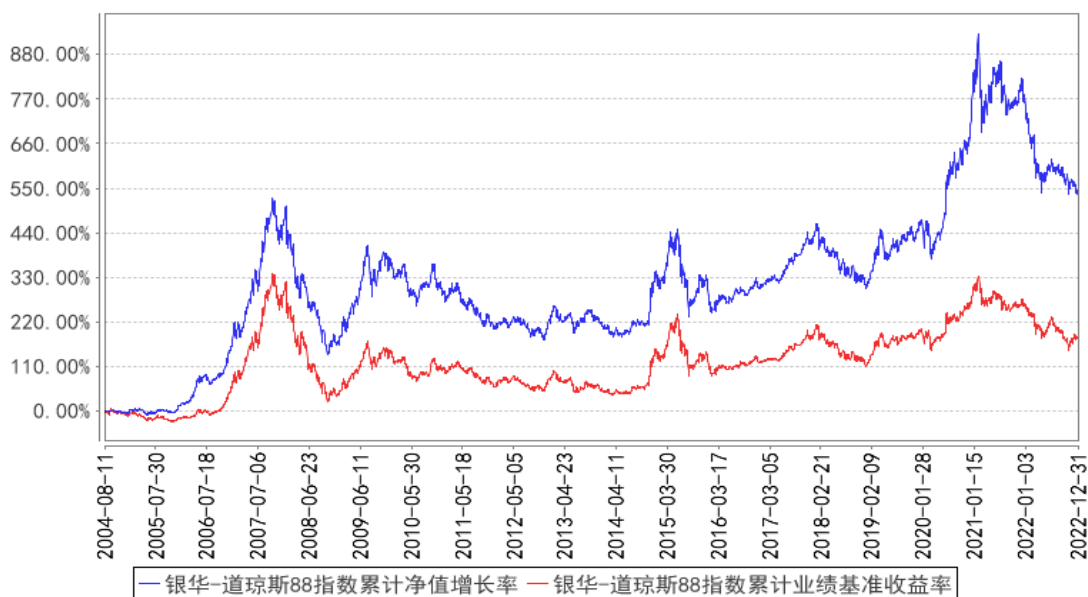
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率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      | -3.67%   | 0.94%       | 1.13%      | 1.45%         | -4.80%  | -0.51% |
| 过去六个月      | -9.80%   | 0.85%       | -15.16%    | 1.21%         | 5.36%   | -0.36% |
| 过去一年       | -26.34%  | 1.16%       | -22.52%    | 1.37%         | -3.82%  | -0.21% |
| 过去三年       | 15.08%   | 1.45%       | -5.24%     | 1.36%         | 20.32%  | 0.09%  |
| 过去五年       | 23.63%   | 1.36%       | -0.31%     | 1.35%         | 23.94%  | 0.01%  |
| 自基金合同生效起至今 | 543.99%  | 1.47%       | 181.65%    | 1.66%         | 362.34% | -0.19% |

### 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

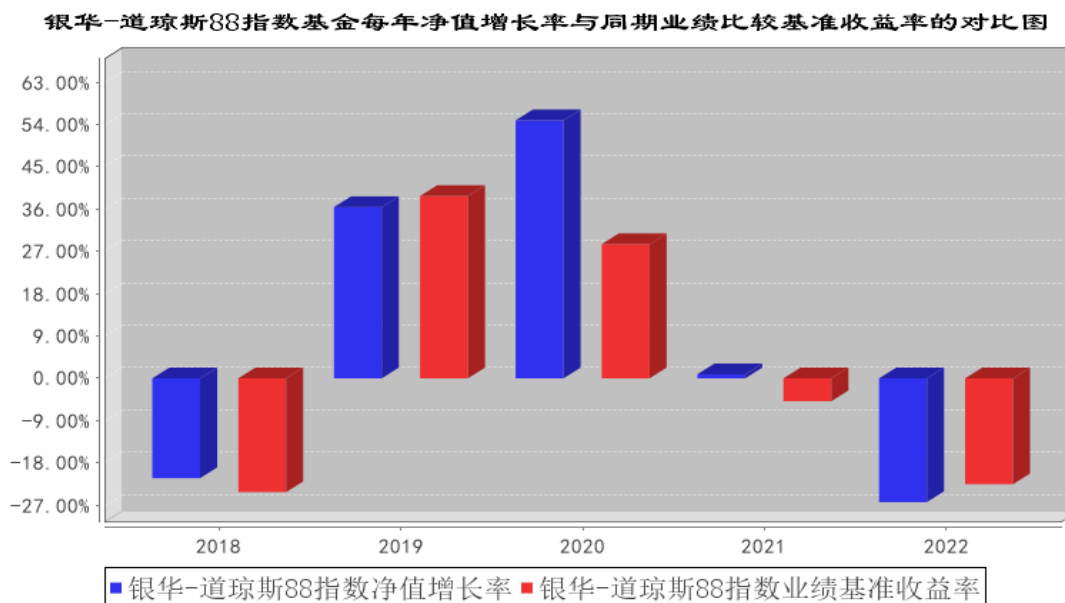
银华-道琼斯88指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，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：本基金股票资产投资比例上限为 95%，且保持不低于基金资

产 5% 的现金或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、应收申购款等。

### 3.2.3 过去五年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



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

单位：人民币元

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额      | 年度利润分配合计       | 备注 |
|--------|---------------|----------------|----------------|----------------|----|
| 2022 年 | -             | -              | -              | -              | -  |
| 2021 年 | 1.9480        | 171,742,014.44 | 92,777,073.06  | 264,519,087.50 | -  |
| 2020 年 | 2.2350        | 221,438,540.04 | 109,970,114.36 | 331,408,654.40 | -  |
| 合计     | 4.1830        | 393,180,554.48 | 202,747,187.42 | 595,927,741.90 | -  |

## § 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 12 月 31 日,本基金管理人管理 183 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、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金

中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值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 |        |  |
| 周晶女士 | 本基金的基金经理 | 2018 年 11 月 12 日 | -    | 16 年   | 硕士学位。曾就职于银华基金管理有限公司、中欧基金管理有限公司。2018 年 8 月再次加入银华基金，现任投资管理一部基金经理。自 2018 年 11 月 12 日起担任银华-道琼斯 88 精选证券投资基金基金经理，自 2018 年 12 月 27 日起兼任银华沪港深增长股票型证券投资基金基金经理，自 2022 年 9 月 29 日起兼任银华积极精选混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
- 3、李旻先生自 2023 年 1 月 29 日起开始担任本基金的基金经理。
- 4、陈梦舒先生自 2023 年 1 月 31 日起开始担任本基金的基金经理。

#### 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-道琼斯 88 精选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 32 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

岁末年初，刚刚过去的 2022 年，无疑是全球金融市场参与者都比较痛苦的一年，我们一起经历了太多黑天鹅、灰犀牛事件冲击带来的资产价格下行，留下了痛苦的记忆和缩水的净值。但投资大师戴维斯有句名言：“作为一个股市投资者，你的大多数钱其实都是在熊市里赚到的，只是你没有意识到罢了。”除了熊市意味着低估值、意味着基本面即将见底反转之外，专业投资者们必须要做的事情是，在复盘本轮完整牛熊周期的过程中，寻找下一轮市场启动的引擎和脉络。笔者作为专业投资者，也在反思去年业绩表现不佳原因的同时，对这个问题进行了一些思考。

从道 88 去年的业绩归因分析来看，主力亏损源于两个部分，首先是前两年对组合贡献巨大的超级成长股们的巨幅下跌；其次则是 2019 年以来市场给予最高溢价的核心资产们的下跌。两类资产下跌的核心驱动因素当然都是国内经济下行周期和美国货币紧缩周期带来的企业盈利和估值承压，但最终超级成长股的跌幅远大于核心资产，对这个问题，我个人的解读是，这些在过去三五年间由小长大的公司在快速成长期就如在快车道上行驶，思考的都是如何跑得更快，几乎没有为经济周期性下行或行业增速下台阶做准备和预案，因此我们看到这些成长股在需求下行时出现了较为明显的业绩下滑，股价除了跌去业绩低于预期部分之外，还将市场在其成长期所给予的，公

司可以由小长大，从优秀到卓越的美好期望也跌掉了，估值可以从 40-50 倍下杀至 20 倍以下；而核心资产大部分是经历了若干轮宏观经济周期的行业龙头，这帮老司机们虽然同样增长承压，但最终给资本市场呈现出来的报表数据大部分是可以体现出显著的抗周期冲击能力的，他们的盈利下行幅度和估值下杀幅度也就相对而言有限。

回顾我们在 2021 年年报中的展望，我们其实已经意识到上述风险，我们在年报中写到：“2022 年（至少是上半年）大概率是企业盈利增速普遍下行的阶段，我们选择降低高估值、高预期股票在组合中的占比，来回避经济下行阶段权益市场的潜在风险。”

我们的应对策略其实也是可行的，当时我们采取了追寻更高成长的品种来抵御经济下行压力，在年报中我们这样写道：“我们并不认为今年的市场没有机会，因为市场整体估值水平处于历史中枢位置，系统性风险可控，仍具有结构性机会的空间，我们希望买入并持有中期维度尚处于快速成长阶段的细分行业龙头们，企业业绩增长带来的收益是在市场整体充满不确定的背景下，最为确定的收益。”复盘 2022 年，以储能和新技术为代表的新兴成长方向确实在股价上完美抵御了权益市场的下跌，遗憾的是我们重仓的成长股与宏观经济相关度较高，出现了前文所述的，快车道新司机遭遇急弯的问题，未能有效实现我们以成长抵御周期下行压力的最初设想。

对于一直追求以对行业和企业的深度研究来创造超额收益的我们，上述困境似乎也不偶然，深度意味着覆盖面的狭窄，换言之，我们需要更清晰意识到专注在手中已有品种的机会成本并不低，在我们的框架内，必须对研究深度和前瞻性提出更高要求，通过提高选股胜率来充分体现研究创造的价值，此外，对股票估值和预期处于高位时的风险给予更多重视，本轮牛熊再次证明，一切以宏大叙事展开的高估值最终都是要还债的。

#### 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 1.1934 元；本报告期基金份额净值增长率为-26.34%，业绩比较基准收益率为-22.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国的著名零售分析师约瑟夫.H.埃利斯曾经有一本比较著名的书叫《走在曲线之前》，他在书中将美国股市的前瞻指标总结为美国实际工资收入的增速变化，也即当美国扣除通胀的单位劳动收入增长放缓时，其实预示着股票市场的这个上涨行将结束，反之亦然，而并非我们通常意义上观察的 GDP 增速、美联储货币政策、就业率等指标。在此观点的启发之下，我们对中国的权益市场过往的几轮牛熊进行复盘，中国的股市出现大牛市时，一般是以下三个因素中的至少两个发生共振所致，第一是来自美国的需求也就是美国消费也即埃利斯所提到的美国实际劳动力收入的增长提速；第二是中国的内需提速，这里面既包括我们一般意义的消费品、也包括像住房、以

及我们的政府支出，也即基础设施建设。第三则是来自于新的技术创新周期带来的需求，例如正在进行中的新能源汽车带来的技术周期以及 2013-2015 年由移动互联网普及和智能手机渗透率提升所带来的技术创新周期。若只有一个因素向好，其他因素走平，则市场走小牛，若两个因素同时走弱则为熊市。

例如，从 2006 年到 2007 年的一轮大牛市，是由美国消费和中国的消费所双轮驱动的，此后美国消费大部分时候是个偏走平的变量，2009 年到 2010 年的牛市则是中国内需政策大力出奇迹的结果，2013 到 2015 年的大牛市，主要是技术周期叠加了国内经济弱复苏，而 2017 到 2018 年的那一轮小牛市，主要是我国内需所驱动的，2019 到 2021 年的牛市，则是由美国消费强劲复苏叠加新能源车所驱动的技术周期。

如果我们按照以上的思路去思考 2023 年的资本市场，以上三个变量中最为确定的驱动因素是内需的恢复，美国消费大概率是负面贡献，技术驱动因素大概率走平。因此，我们对 2023 年行情的判断是可为的，但并非全面牛市的这样的一个偏结构性行情的市场。

在这样的一个基本判断下，我们的投资策略是，首先牢牢把握最为确定的市场驱动引擎，也就是消费复苏所带动的经济增长。这部分的公司在过去的两三个月里其实已经有了相对比较好的股价表现，但我们认为在接下来基数较低的三个季度以内，消费品中会有部分企业的复苏强度比市场线下的预期更为亮眼。这些具有比较强的阿尔法属性的标的，将是我们接下来需要研究挖掘的重点标的。

其次，我们也会密切的观察除了内需消费之外，其他有可能驱动市场上行的主线逻辑，包括技术进步，也包括海外经济周期的进程。

交易节奏上，我们会对股价中基本面预期的乐观程度做较为严苛的研判，对于股价远远超越基本面所能支撑水平的公司，我们会采取比较谨慎的态度，相反的。市场从一个相对较低估值水位回升至今，依然会有大量的优质标的，他们在过去两年的经济低迷期实现了竞争力的提升，实现了行业格局的改善，只是暂时没有在公司的经营业绩上面得到比较充分的体现，因此股价还处于一个相对低估的水平，这一部分的标的是我们认为在中长期最有价值和空间的投资标的。过去两年跌幅比较大，估值比较低、宏观关联度强、质地好的白马都是值得重点关注的品种。

#### 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 4.9 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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、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 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     | 安永华明（2023）审字第 61329181_A02 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-道琼斯 88 精选证券投资基金全体基金份额持有人：   |
| 审计意见      | 我们审计了银华-道琼斯 88 精选证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为，后附的银华-道琼斯 88 精选证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华-道琼斯 88 精选证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。  |
| 强调事项      | 无。   |

|                 |   |
|-----------------|---|
| 其他事项            | 无。  |
| 其他信息            | <p>银华-道琼斯 88 精选证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估银华-道琼斯 88 精选证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督银华-道琼斯 88 精选证券投资基金的财务报告过程。</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>(1) 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>(2) 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>(3) 评价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>(4) 对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，就可能导致对银华-道琼斯 88 精选证券投资基金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</p> |

|           |   |     |
|-----------|---|-----|
|           | <p>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-道琼斯 88 精选证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  |     |
| 注册会计师的姓名  | 王珊珊   | 朱 燕 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 北京   |     |
| 审计报告日期    | 2023 年 03 月 29 日  |     |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银华-道琼斯 88 精选证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 100,315,795.61          | 278,737,241.11           |
| 结算备付金      |         | 722,890.99              | 4,268,303.81             |
| 存出保证金      |         | 159,950.45              | 352,917.32               |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 1,230,184,213.09        | 2,026,419,593.82         |
| 其中：股票投资    |         | 1,230,184,213.09        | 2,026,419,593.82         |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |
| 债券投资       |         | -                       | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                       | -                        |
| 其他投资       |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产     | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产   | 7.4.7.4 | -                       | -                        |
| 债权投资       | 7.4.7.5 | -                       | -                        |
| 其中：债券投资    |         | -                       | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                       | -                        |
| 其他投资       |         | -                       | -                        |
| 其他债权投资     | 7.4.7.6 | -                       | -                        |
| 其他权益工具投资   | 7.4.7.7 | -                       | -                        |
| 应收清算款      |         | 13,412,918.49           | -                        |
| 应收股利       |         | -                       | -                        |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收申购款         |            | 164,626.94                 | 655,419.58                  |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | 233.25                     | 39,513.44                   |
| 资产总计          |            | 1,344,960,628.82           | 2,310,472,989.08            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年12月31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        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | -                          | 11,439,308.87               |
| 应付赎回款         |            | 1,844,891.56               | 2,155,690.70                |
| 应付管理人报酬       |            | 1,383,791.40               | 2,523,647.51                |
| 应付托管费         |            | 288,289.92                 | 525,759.89                  |
| 应付销售服务费       |            | -                          | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | -                          | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.9    | 935,051.87                 | 1,696,395.22                |
| 负债合计          |            | 4,452,024.75               | 18,340,802.19               |
| <b>净资产:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.10   | 1,123,295,095.98           | 1,414,778,821.89            |
| 其他综合收益        | 7.4.7.11   | -                          | -                           |
| 未分配利润         | 7.4.7.12   | 217,213,508.09             | 877,353,365.00              |
| 净资产合计         |            | 1,340,508,604.07           | 2,292,132,186.89            |
| 负债和净资产总计      |            | 1,344,960,628.82           | 2,310,472,989.08            |

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1934 元，基金份额总额 1,123,295,095.98 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银华-道琼斯 88 精选证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 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                          |
|----------------|----------|----------------------------------|----------------------------------|
|                |          | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
| <b>一、营业总收入</b> |          | -527,324,463.28                  | 88,752,402.66                    |
| 1. 利息收入        |          | 800,050.27                       | 980,566.55                       |
| 其中：存款利息收入      | 7.4.7.13 | 800,050.27                       | 980,566.55                       |
| 债券利息收入         |          | -                                | -                                |

|                            |            |                 |                 |
|----------------------------|------------|-----------------|-----------------|
| 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）          |            | -116,052,767.06 | 634,080,958.94  |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.14   | -137,694,063.53 | 623,904,610.64  |
| 基金投资收益                     |            | -               | -               |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.15   | 371,532.10      | -               |
| 资产支持证券投资                   | 7.4.7.16   | -               | -               |
| 收益                         |            |                 |                 |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.17   | -               | -               |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.18   | -               | -               |
| 股利收益                       | 7.4.7.19   | 21,269,764.37   | 10,176,348.30   |
| 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）     | 7.4.7.20   | -412,632,514.76 | -547,689,446.77 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -               | -               |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.21   | 560,768.27      | 1,380,323.94    |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 22,477,015.09   | 40,194,078.07   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 18,396,493.34   | 26,283,280.78   |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 3,832,602.91    | 5,475,683.51    |
| 3. 销售服务费                   |            | -               | -               |
| 4. 投资顾问费                   |            | -               | -               |
| 5. 利息支出                    |            | -               | -               |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -               | -               |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -               | -               |
| 7. 税金及附加                   |            | -               | -               |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.23   | 247,918.84      | 8,435,113.78    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -549,801,478.37 | 48,558,324.59   |
| 减：所得税费用                    |            | -               | -               |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -549,801,478.37 | 48,558,324.59   |
| <b>五、其他综合收益的税后</b>         |            | -               | -               |

|          |  |                 |               |
|----------|--|-----------------|---------------|
| 净额       |  |                 |               |
| 六、综合收益总额 |  | -549,801,478.37 | 48,558,324.59 |

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华-道琼斯 88 精选证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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)                   | 1,414,778,821.89                       | -      | 877,353,365.00  | 2,292,132,186.89 |
| 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)                   | 1,414,778,821.89                       | -      | 877,353,365.00  | 2,292,132,186.89 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)              | -291,483,725.91                        | -      | -660,139,856.91 | -951,623,582.82  |
| (一)、综合收益总额                        | -                                      | -      | -549,801,478.37 | -549,801,478.37  |
| (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) | -291,483,725.91                        | -      | -110,338,378.54 | -401,822,104.45  |

|  |                                  |        |                  |                  |
|--|----------------------------------|--------|------------------|------------------|
| 填列)  |                                  |        |                  |                  |
| 其中:1.<br>基金申<br>购款   | 84,104,631.47                    | -      | 26,690,021.32    | 110,794,652.79   |
| 2<br>.基金赎<br>回款  | -375,588,357.38                  | -      | -137,028,399.86  | -512,616,757.24  |
| (三)、<br>本期向<br>基金份<br>额持有<br>人分配<br>利润产<br>生的基<br>金净值<br>变动(净<br>值减少<br>以“-”<br>号填列) | -                                | -      | -                | -                |
| (四)、<br>其他综<br>合收益<br>结转留<br>存收益   | -                                | -      | -                | -                |
| 四、本期<br>期末净<br>资产(基<br>金净值)  | 1,123,295,095.98                 | -      | 217,213,508.09   | 1,340,508,604.07 |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |        |                  |                  |
|  | 实收基金                             | 其他综合收益 | 未分配利润            | 净资产合计            |
| 一、上期<br>期末净<br>资产(基<br>金净值)  | 1,531,700,116.22                 | -      | 1,228,681,751.49 | 2,760,381,867.71 |
| 加:会计<br>政策变<br>更   | -                                | -      | -                | -                |
| 前期差<br>错更正   | -                                | -      | -                | -                |
| 其他   | -                                | -      | -                | -                |
| 二、本期   | 1,531,700,116.22                 | -      | 1,228,681,751.49 | 2,760,381,867.71 |

|  |                 |   |                 |                   |
|--|-----------------|---|-----------------|-------------------|
| 期初净资产(基金净值)                              |                 |   |                 |                   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -116,921,294.33 | - | -351,328,386.49 | -468,249,680.82   |
| (一)、综合收益总额                               | -               | - | 48,558,324.59   | 48,558,324.59     |
| (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)      | -116,921,294.33 | - | -135,367,623.58 | -252,288,917.91   |
| 其中:1.基金申购款                               | 563,726,800.64  | - | 471,412,229.02  | 1,035,139,029.66  |
| 2.基金赎回款                                  | -680,648,094.97 | - | -606,779,852.60 | -1,287,427,947.57 |
| (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) | -               | - | -264,519,087.50 | -264,519,087.50   |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -               | - | -               | -                 |



|                |                  |   |                |                  |
|----------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 四、本期末净资产(基金净值) | 1,414,778,821.89 | - | 877,353,365.00 | 2,292,132,186.89 |
|----------------|------------------|---|----------------|------------------|

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <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    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银华-道琼斯 88 精选证券投资基金（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”）证监基金字[2004]82 号文《关于同意银华-道琼斯 88 精选证券投资基金设立的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于 2004 年 7 月 5 日至 2004 年 8 月 5 日向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 8 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 1,085,604,444.01 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

为向香港投资人提供更为丰富的投资品种，本基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定于 2018 年 9 月 7 日起对本基金增设 H 类基金份额，并对本基金的基金合同及托管协议作相应修改。本基金在中国内地销售的基金份额类别称为 A 类基金份额；在中国香港特别行政区销售的基金份额类别称为 H 类基金份额。本基金 A 类基金份额、H 类基金份额分别设置基金代码，并分别计算基金份额净值。本基金新增加的 H 类基金份额类别，仅在中国香港地区销售。截至本报告期末，H 类基金份额尚未实际销售。

根据《银华基金管理股份有限公司关于银华-道琼斯 88 精选证券投资基金撤销 H 类基金份额并修改基金合同的公告》，由于市场环境变化，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定自 2021 年 7 月 20 日起对本基金撤销 H 类基金份额，并对本基金的基金合同、托管协议及更新的招募说明书做相应修改。自 2021 年 7 月 20 日起，本基金撤销 H 类基金份额，该类份额在香港销售、为香港投资者设立。撤销 H 类份额后，本基金不再区分不同的基金份额类别。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括道琼斯中国 88 指数的成份 A 股及其备选成份股、新股（首发或增发）、存托凭证、债券资产（国债、金融债、企业债、可转债等债券资产）

以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，各类资产投资比例符合《证券投资基金法》的规定。在资产类别配置上，本基金股票资产投资比例上限为 95%，且保持不低于基金资产 5% 的现金或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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为道琼斯中国 88 指数收益率。

#### 7.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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 2 号《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 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。

#### 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

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公

允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(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) 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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

(1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利自动转为基金份额进行再投资；选择采取红利再投资形式的，分红现金按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额；本基金分红的默认方式为现金方式；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(4) 如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；

(5) 基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

(6) 基金收益分配比例按照有关规定执行；

(7)在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至少一次,成立不满三个月,收益可不分配;

(8)红利分配时所发生的银行转账或其他注册登记费用由投资者自行承担;

(9)法律、法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

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》的规定和相关法律法规的要求,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。此外,本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》(财会[2022]14 号)。

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。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

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 278,737,241.11 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 36,992.63 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 278,774,233.74 元。

结算备付金于 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 4,268,303.81 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,112.88 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，结算备付金于 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 4,270,416.69 元。

存出保证金于 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 352,917.32 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 174.68 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，存出保证金于 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 353,092.00 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 39,280.19 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 36,992.63 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,112.88 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 174.68 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 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。

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。



#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%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；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 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<br>2022 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 100,315,795.61          | 278,737,241.11           |
| 等于：本金          | 100,299,045.87          | 278,737,241.11           |
| 加：应计利息         | 16,749.74               | -                        |
| 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             | 100,315,795.61          | 278,737,241.11           |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 12 月 31 日  |      |                  |                |
|---------------|--------------------------|------|------------------|----------------|
|               | 成本                       | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | 1,272,369,996.73         | -    | 1,230,184,213.09 | -42,185,783.64 |
| 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            | 1,272,369,996.73         | -    | 1,230,184,213.09 | -42,185,783.64 |
| 项目            | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |      |                  |                |
|               | 成本                       | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | 1,655,972,862.70         | -    | 2,026,419,593.82 | 370,446,731.12 |

|               |                  |   |                  |                |
|---------------|------------------|---|------------------|----------------|
| 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            | 1,655,972,862.70 | - | 2,026,419,593.82 | 370,446,731.12 |

#### 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 债权投资

注：无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

注：无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

注：无。

#### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 应收利息  | -                  | 39,280.19           |
| 其他应收款 | 233.25             | 233.25              |
| 待摊费用  | -                  | -                   |
| 合计    | 233.25             | 39,513.44           |

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 2,787.04           | 1,832.23            |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 462,263.68         | 1,224,561.84        |
| 其中：交易所市场    | 462,263.68         | 1,224,561.84        |

|       |            |              |
|-------|------------|--------------|
| 银行间市场 | -          | -            |
| 应付利息  | -          | -            |
| 预提费用  | 210,000.00 | 210,000.00   |
| 其他    | 260,001.15 | 260,001.15   |
| 合计    | 935,051.87 | 1,696,395.22 |

#### 7.4.7.10 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12月31日 |                  |
|---------------|-----------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,414,778,821.89            | 1,414,778,821.89 |
| 本期申购          | 84,104,631.47               | 84,104,631.47    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -375,588,357.38             | -375,588,357.38  |
| 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           | 1,123,295,095.98            | 1,123,295,095.98 |

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。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 7.4.7.12 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           | 1,186,599,909.12 | -309,246,544.12 | 877,353,365.00  |
| 本期利润           | -137,168,963.61  | -412,632,514.76 | -549,801,478.37 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -234,255,276.02  | 123,916,897.48  | -110,338,378.54 |
| 其中：基金申购款       | 63,206,277.30    | -36,516,255.98  | 26,690,021.32   |
| 基金赎回款          | -297,461,553.32  | 160,433,153.46  | -137,028,399.86 |
| 本期已分配利润        | -                | -               | -               |
| 本期末            | 815,175,669.49   | -597,962,161.40 | 217,213,508.09  |

#### 7.4.7.13 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12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                    | 772,292.95                       |
| 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 | 21,817.42                   | 28,254.82                        |

|    |            |            |
|----|------------|------------|
| 其他 | 5,939.90   | 6,960.79   |
| 合计 | 800,050.27 | 980,566.55 |

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|----------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资收益——买卖<br>股票差价收入 | -137,694,063.53             | 623,904,610.64                   |
| 股票投资收益——赎回<br>差价收入   | -                           | -                                |
| 股票投资收益——申购<br>差价收入   | -                           | -                                |
| 股票投资收益——证券<br>出借差价收入 | -                           | -                                |
| 合计                   | -137,694,063.53             | 623,904,610.64                   |

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额       | 1,991,332,094.83            | 3,002,304,026.70                 |
| 减：卖出股票成本<br>总额 | 2,123,362,386.34            | 2,378,399,416.06                 |
| 减：交易费用         | 5,663,772.02                | -                                |
| 买卖股票差价收入       | -137,694,063.53             | 623,904,610.64                   |

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息 | 393,534.24                  | -                                |

|                              |            |   |
|------------------------------|------------|---|
| 收入                           |            |   |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -22,002.14 | - |
| 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                           | 371,532.10 | - |

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 30,537,274.57               | -                                |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 30,019,000.00               | -                                |
| 减：应计利息总额               | 540,246.57                  | -                                |
| 减：交易费用                 | 30.14                       | -                                |
| 买卖债券差价收入               | -22,002.14                  | -                                |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利 | 21,269,764.37               | 10,176,348.30                    |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 收益            |               |               |
| 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            | 21,269,764.37 | 10,176,348.30 |

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2022年1月1日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -412,632,514.76                 | -547,689,446.77                      |
| 股票投资                   | -412,632,514.76                 | -547,689,446.77                      |
| 债券投资                   | -                               | -                                    |
| 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                     | -412,632,514.76                 | -547,689,446.77                      |

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 559,605.93                      | 1,236,677.16                         |
| 基金转换费收入 | 1,162.34                        | 13,358.43                            |
| 其他      | -                               | 130,288.35                           |
| 合计      | 560,768.27                      | 1,380,323.94                         |

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2022年1月1日至2022年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |
|------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 90,000.00                       | 90,000.00                            |



|         |            |              |
|---------|------------|--------------|
| 信息披露费   | 120,000.00 | 120,000.00   |
| 证券出借违约金 | -          | -            |
| 银行费用    | 718.84     | 13,771.39    |
| 账户维护费   | 37,200.00  | 37,200.00    |
| 交易费用    | -          | 8,174,142.39 |
| 合计      | 247,918.84 | 8,435,113.78 |

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大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”）     | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）   | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 东北证券股份有限公司（“东北证券”）     | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 山西海鑫实业有限公司             | 基金管理人的股东        |
| 珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东        |
| 珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东        |
| 珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)     | 基金管理人的股东        |
| 银华基金管理股份有限公司           | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 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       | 基金管理人的子公司       |
| 银华国际资本管理有限公司           | 基金管理人的子公司       |
| 深圳银华永泰创新投资有限公司         | 基金管理人的子公司的子公司   |

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<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |                 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021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  | 707,866,535.06              | 19.01           | 889,344,782.55                   | 16.32           |

|      |                |       |                |      |
|------|----------------|-------|----------------|------|
| 东北证券 | 488,868,509.04 | 13.13 | -              | -    |
| 西南证券 | 31,819,728.60  | 0.85  | 158,196,336.17 | 2.90 |

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |                         | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                         |
|-------|-----------------------------|-------------------------|----------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                             | 占当期债券<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 第一创业  | 40,014,028.00               | 66.67                   | -                                | -                       |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年12月31日      |                    |              |                      |
|-------|----------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 东北证券  | 455,283.74                       | 13.66              | 165,329.73   | 35.77                |
| 第一创业  | 659,226.03                       | 19.78              | 93,171.72    | 20.16                |
| 西南证券  | 29,633.74                        | 0.89               | 29,633.74    | 6.41                 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 第一创业  | 828,248.56                       | 17.91              | 62,182.63    | 5.08                 |
| 西南证券  | 134,356.81                       | 2.91               | 47,430.92    | 3.87                 |

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

#### 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<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
|    |                             |                                  |

|                 | 月 31 日        | 12 月 31 日     |
|-----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 18,396,493.34 | 26,283,280.78 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,893,588.04  | 4,020,005.15  |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,832,602.91                     | 5,475,683.51                     |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

#### 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

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                               |            | 上年度可比期间                          |            |
|--------|----------------------------------|------------|----------------------------------|------------|
|        | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |            | 2021 年 1 月 1 日至 2021 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     |
| 中国建设银行 | 100,315,795.61                   | 772,292.95 | 278,737,241.11                   | 945,350.94 |

#### 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：本基金本报告期末进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |     |        |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 301176               | 逸豪新材 | 2022年9月21日 | 6个月 | 新股流通受限 | 23.88 | 16.89  | 544      | 12,990.72 | 9,188.16  | -  |
| 301227               | 森鹰窗业 | 2022年9月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 38.25 | 29.49  | 284      | 10,863.00 | 8,375.16  | -  |
| 301316               | 慧博云通 | 2022年9月29日 | 6个月 | 新股流通受限 | 7.60  | 14.32  | 359      | 2,728.40  | 5,140.88  | -  |
| 301319               | 唯特偶  | 2022年9月22日 | 6个月 | 新股流通受限 | 47.75 | 53.27  | 115      | 5,491.25  | 6,126.05  | -  |
| 301363               | 美好医疗 | 2022年9月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 30.66 | 37.85  | 445      | 13,643.70 | 16,843.25 | -  |
| 301366               | 一博科技 | 2022年9月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 65.35 | 45.09  | 268      | 17,513.80 | 12,084.12 | -  |

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期        | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘价 | 数量（股）   | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------------|-------|---------|---------------|---------------|----|
| 600038 | 中直股份 | 2022年12月26日 | 重大事项停牌 | 46.41  | 2023年1月10日 | 51.05 | 286,300 | 13,649,391.00 | 13,287,183.00 | -  |

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

#### 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<br>2022 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                    | 100,315,795.61 | -     | -     | -                 | 100,315,795.61   |
| 结算备付金                   | 722,890.99     | -     | -     | -                 | 722,890.99       |
| 存出保证金                   | 159,950.45     | -     | -     | -                 | 159,950.45       |
| 交易性金融资产                 | -              | -     | -     | -1,230,184,213.09 | 1,230,184,213.09 |
| 应收申购款                   | -              | -     | -     | 164,626.94        | 164,626.94       |

|                          |                |       |       |                   |                  |
|--------------------------|----------------|-------|-------|-------------------|------------------|
| 应收清算款                    | -              | -     | -     | 13,412,918.49     | 13,412,918.49    |
| 其他资产                     | -              | -     | -     | 233.25            | 233.25           |
| 资产总计                     | 101,198,637.05 | -     | -     | -1,243,761,991.77 | 1,344,960,628.82 |
| 负债                       |                |       |       |                   |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 1,844,891.56      | 1,844,891.56     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 1,383,791.40      | 1,383,791.40     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 288,289.92        | 288,289.92       |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 935,051.87        | 935,051.87       |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 4,452,024.75      | 4,452,024.75     |
| 利率敏感度缺口                  | 101,198,637.05 | -     | -     | -1,239,309,967.02 | 1,340,508,604.07 |
| 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                     | 278,737,241.11 | -     | -     | -                 | 278,737,241.11   |
| 结算备付金                    | 4,268,303.81   | -     | -     | -                 | 4,268,303.81     |
| 存出保证金                    | 352,917.32     | -     | -     | -                 | 352,917.32       |
| 交易性金融资产                  | -              | -     | -     | -2,026,419,593.82 | 2,026,419,593.82 |
| 应收申购款                    | -              | -     | -     | 655,419.58        | 655,419.58       |
| 其他资产                     | -              | -     | -     | 39,513.44         | 39,513.44        |
| 资产总计                     | 283,358,462.24 | -     | -     | -2,027,114,526.84 | 2,310,472,989.08 |
| 负债                       |                |       |       |                   |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 2,155,690.70      | 2,155,690.70     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 2,523,647.51      | 2,523,647.51     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 525,759.89        | 525,759.89       |
| 应付证券清算款                  | -              | -     | -     | 11,439,308.87     | 11,439,308.87    |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 1,696,395.22      | 1,696,395.22     |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 18,340,802.19     | 18,340,802.19    |
| 利率敏感度缺口                  | 283,358,462.24 | -     | -     | -2,008,773,724.65 | 2,292,132,186.89 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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（如有）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净资产无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022年12月31日 |                  | 上年度末<br>2021年12月31日 |                  |
|---------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 1,230,184,213.09   | 91.77            | 2,026,419,593.82    | 88.41            |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -                | -                   | -                |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                  | -                | -                   | -                |
| 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            | 1,230,184,213.09   | 91.77            | 2,026,419,593.82    | 88.41            |

#### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |                             |                   |
|----|--|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；                        |                             |                   |
|    | 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；           |                             |                   |
|    | Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 |                             |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |  | 本期末（2022年12月31日）            | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升 5%                                      | 49,539,152.55               | 124,896,830.91    |
|    | 业绩比较基准下降 5%                                      | -49,539,152.55              | -124,896,830.91   |



#### 7.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 1,216,839,272.47        | 2,024,551,814.15         |
| 第二层次          | 13,287,183.00           | 5,504.49                 |
| 第三层次          | 57,757.62               | 1,862,275.18             |
| 合计            | 1,230,184,213.09        | 2,026,419,593.82         |

###### 7.4.14.2.2 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、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----|--|
|----|--|

|  | 交易性金融资产                          |              | 合计           |
|--|----------------------------------|--------------|--------------|
|  | 债券投资                             | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -                                | 1,862,275.18 | 1,862,275.18 |
| 当期购买                                       | -                                | 63,230.87    | 63,230.87    |
| 当期出售/结算                                    | -                                | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -                                | -            | -            |
| 转出第三层次                                     | -                                | 1,862,275.18 | 1,862,275.18 |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                | -5,473.25    | -5,473.25    |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                | -5,473.25    | -5,473.25    |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                | -            | -            |
| 期末余额                                       | -                                | 57,757.62    | 57,757.62    |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                | -5,473.25    | -5,473.25    |
| 项目   | 上年度可比同期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |              |              |
|  | 交易性金融资产                          |              | 合计           |
|  | 债券投资                             | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -                                | 4,090,049.39 | 4,090,049.39 |
| 当期购买                                       | -                                | 917,420.26   | 917,420.26   |
| 当期出售/结算                                    | -                                | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -                                | -            | -            |
| 转出第三层次                                     | -                                | 4,090,049.39 | 4,090,049.39 |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                | 944,854.92   | 944,854.92   |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                | 944,854.92   | 944,854.92   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                | -            | -            |
| 期末余额                                       | -                                | 1,862,275.18 | 1,862,275.18 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                | 944,854.92   | 944,854.92   |

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估 | 不可观察输入值 |
|----|---------|------|---------|
|----|---------|------|---------|

|      | 值            | 值技术                | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
|------|--------------|--------------------|---------|---------------|------------|
| 限售股票 | 57,757.62    | 平均价格<br>亚式期权<br>模型 | 预期波动率   | 0.3073-2.4756 | 负相关        |
| 项目   | 上年度末公允价值     | 采用的估值技术            | 不可观察输入值 |               |            |
|      |              |                    | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 限售股票 | 1,862,275.18 | 平均价格<br>亚式期权<br>模型 | 预期波动率   | 0.2434-2.7417 | 负相关        |

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

比较数据已根据本年《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>》中资产负债表和利润表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

除以上事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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              | 1,230,184,213.09 | 91.47         |
|    | 其中：股票             | 1,230,184,213.09 | 91.47         |
| 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      | 101,038,686.60   | 7.51          |
| 8  | 其他各项资产            | 13,737,729.13    | 1.02          |
| 9  | 合计                | 1,344,960,628.82 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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         | 44,253,566.50  | 3.30          |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 424,988,408.96 | 31.70         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,100.00       | -             |
| E  | 建筑业              | 101,486,967.60 | 7.57          |
| F  | 批发和零售业           | -              | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 13,868,176.00  | 1.03          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,283.00       | -             |
| J  | 金融业              | 70,038,295.88  | 5.22          |
| K  | 房地产业             | 54,849,583.00  | 4.09          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 51,748,710.23  | 3.86          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 8,100.00       | -             |
| 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       | 4,039.10       | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 761,251,230.27 | 56.79 |

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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         | 13,225,850.00  | 0.99         |
| B  | 采矿业              | 17,887,089.98  | 1.33         |
| C  | 制造业              | 350,060,720.96 | 26.11        |
| 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           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 87,745,175.00  | 6.55         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 5,140.88       | 0.00         |
| J  | 金融业              | 6,720.00       | 0.00         |
| K  | 房地产业             | 2,286.00       | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| 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               | 468,932,982.82 | 34.98        |

### 8.2.3 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。

## 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

## 8.3.1 期末指数投资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  | 600519 | 贵州茅台 | 72,575     | 125,337,025.00 | 9.35         |
| 2  | 600690 | 海尔智家 | 3,836,307  | 93,836,069.22  | 7.00         |
| 3  | 601668 | 中国建筑 | 11,460,600 | 62,231,058.00  | 4.64         |
| 4  | 600048 | 保利发展 | 3,625,100  | 54,847,763.00  | 4.09         |
| 5  | 601888 | 中国中免 | 239,541    | 51,748,042.23  | 3.86         |
| 6  | 600309 | 万华化学 | 463,311    | 42,925,764.15  | 3.20         |
| 7  | 601398 | 工商银行 | 9,434,306  | 40,944,888.04  | 3.05         |
| 8  | 601669 | 中国电建 | 5,544,620  | 39,255,909.60  | 2.93         |
| 9  | 600276 | 恒瑞医药 | 820,420    | 31,610,782.60  | 2.36         |
| 10 | 002714 | 牧原股份 | 626,382    | 30,536,122.50  | 2.28         |
| 11 | 002049 | 紫光国微 | 216,532    | 28,543,248.24  | 2.13         |
| 12 | 300124 | 汇川技术 | 401,250    | 27,886,875.00  | 2.08         |
| 13 | 002594 | 比亚迪  | 93,884     | 24,125,371.48  | 1.80         |
| 14 | 002475 | 立讯精密 | 715,939    | 22,731,063.25  | 1.70         |
| 15 | 600893 | 航发动力 | 420,500    | 17,778,740.00  | 1.33         |
| 16 | 002142 | 宁波银行 | 475,222    | 15,420,953.90  | 1.15         |
| 17 | 002352 | 顺丰控股 | 240,100    | 13,868,176.00  | 1.03         |
| 18 | 300498 | 温氏股份 | 698,800    | 13,717,444.00  | 1.02         |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 2,674,756  | 12,678,343.44  | 0.95         |
| 20 | 600522 | 中天科技 | 590,700    | 9,539,805.00   | 0.71         |
| 21 | 300059 | 东方财富 | 50,213     | 974,132.20     | 0.07         |
| 22 | 000858 | 五粮液  | 1,000      | 180,690.00     | 0.01         |
| 23 | 002466 | 天齐锂业 | 1,720      | 135,862.80     | 0.01         |
| 24 | 600809 | 山西汾酒 | 290        | 82,647.10      | 0.01         |
| 25 | 300122 | 智飞生物 | 499        | 43,827.17      | 0.00         |
| 26 | 300750 | 宁德时代 | 100        | 39,342.00      | 0.00         |
| 27 | 300760 | 迈瑞医疗 | 100        | 31,597.00      | 0.00         |
| 28 | 600436 | 片仔癀  | 100        | 28,846.00      | 0.00         |
| 29 | 000568 | 泸州老窖 | 100        | 22,428.00      | 0.00         |
| 30 | 000661 | 长春高新 | 100        | 16,645.00      | 0.00         |
| 31 | 002304 | 洋河股份 | 100        | 16,050.00      | 0.00         |
| 32 | 300274 | 阳光电源 | 100        | 11,180.00      | 0.00         |
| 33 | 603501 | 韦尔股份 | 135        | 10,407.15      | 0.00         |
| 34 | 002460 | 赣锋锂业 | 140        | 9,731.40       | 0.00         |
| 35 | 603259 | 药明康德 | 100        | 8,100.00       | 0.00         |
| 36 | 601012 | 隆基绿能 | 140        | 5,916.40       | 0.00         |
| 37 | 600745 | 闻泰科技 | 100        | 5,258.00       | 0.00         |
| 38 | 000333 | 美的集团 | 100        | 5,180.00       | 0.00         |

|    |        |       |     |          |      |
|----|--------|-------|-----|----------|------|
| 39 | 601318 | 中国平安  | 100 | 4,700.00 | 0.00 |
| 40 | 300015 | 爱尔眼科  | 130 | 4,039.10 | 0.00 |
| 41 | 600036 | 招商银行  | 100 | 3,726.00 | 0.00 |
| 42 | 600660 | 福耀玻璃  | 100 | 3,507.00 | 0.00 |
| 43 | 002415 | 海康威视  | 100 | 3,468.00 | 0.00 |
| 44 | 002230 | 科大讯飞  | 100 | 3,283.00 | 0.00 |
| 45 | 000651 | 格力电器  | 100 | 3,232.00 | 0.00 |
| 46 | 600887 | 伊利股份  | 100 | 3,100.00 | 0.00 |
| 47 | 600585 | 海螺水泥  | 100 | 2,738.00 | 0.00 |
| 48 | 000063 | 中兴通讯  | 100 | 2,586.00 | 0.00 |
| 49 | 600111 | 北方稀土  | 100 | 2,505.00 | 0.00 |
| 50 | 601601 | 中国太保  | 100 | 2,452.00 | 0.00 |
| 51 | 600030 | 中信证券  | 115 | 2,289.65 | 0.00 |
| 52 | 000792 | 盐湖股份  | 100 | 2,269.00 | 0.00 |
| 53 | 600900 | 长江电力  | 100 | 2,100.00 | 0.00 |
| 54 | 000002 | 万科 A  | 100 | 1,820.00 | 0.00 |
| 55 | 601166 | 兴业银行  | 100 | 1,759.00 | 0.00 |
| 56 | 600703 | 三安光电  | 100 | 1,716.00 | 0.00 |
| 57 | 600031 | 三一重工  | 100 | 1,580.00 | 0.00 |
| 58 | 000776 | 广发证券  | 100 | 1,549.00 | 0.00 |
| 59 | 000001 | 平安银行  | 100 | 1,316.00 | 0.00 |
| 60 | 601688 | 华泰证券  | 100 | 1,274.00 | 0.00 |
| 61 | 000338 | 潍柴动力  | 100 | 1,018.00 | 0.00 |
| 62 | 600837 | 海通证券  | 100 | 869.00   | 0.00 |
| 63 | 002027 | 分众传媒  | 100 | 668.00   | 0.00 |
| 64 | 000725 | 京东方 A | 100 | 338.00   | 0.00 |
| 65 | 601288 | 农业银行  | 15  | 43.65    | 0.00 |

### 8.3.2 期末积极投资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  | 601975 | 招商南油 | 12,320,600 | 48,543,164.00 | 3.62         |
| 2  | 600150 | 中国船舶 | 2,075,600  | 46,244,368.00 | 3.45         |
| 3  | 600026 | 中远海能 | 3,252,800  | 39,196,240.00 | 2.92         |
| 4  | 002960 | 青鸟消防 | 1,388,769  | 38,871,644.31 | 2.90         |
| 5  | 002832 | 比音勒芬 | 1,256,100  | 32,168,721.00 | 2.40         |
| 6  | 600875 | 东方电气 | 1,476,300  | 31,031,826.00 | 2.31         |
| 7  | 002831 | 裕同科技 | 848,011    | 28,043,723.77 | 2.09         |
| 8  | 605060 | 联德股份 | 1,043,266  | 26,926,695.46 | 2.01         |
| 9  | 600582 | 天地科技 | 4,141,395  | 21,535,254.00 | 1.61         |
| 10 | 000630 | 铜陵有色 | 6,834,700  | 21,324,264.00 | 1.59         |
| 11 | 601717 | 郑煤机  | 1,482,218  | 16,541,552.88 | 1.23         |
| 12 | 600583 | 海油工程 | 2,729,400  | 16,540,164.00 | 1.23         |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 13 | 603609 | 禾丰股份   | 1,264,800 | 14,975,232.00 | 1.12 |
| 14 | 600038 | 中直股份   | 286,300   | 13,287,183.00 | 0.99 |
| 15 | 002458 | 益生股份   | 951,500   | 13,225,850.00 | 0.99 |
| 16 | 600761 | 安徽合力   | 980,672   | 12,895,836.80 | 0.96 |
| 17 | 300558 | 贝达药业   | 249,600   | 12,297,792.00 | 0.92 |
| 18 | 002810 | 山东赫达   | 522,503   | 11,714,517.26 | 0.87 |
| 19 | 002885 | 京泉华    | 254,500   | 7,589,190.00  | 0.57 |
| 20 | 600487 | 亨通光电   | 453,225   | 6,825,568.50  | 0.51 |
| 21 | 600416 | 湘电股份   | 301,337   | 5,665,135.60  | 0.42 |
| 22 | 688271 | 联影医疗   | 7,365     | 1,303,457.70  | 0.10 |
| 23 | 600938 | 中国海油   | 84,004    | 1,276,860.80  | 0.10 |
| 24 | 300896 | 爱美客    | 868       | 491,591.80    | 0.04 |
| 25 | 600143 | 金发科技   | 7,764     | 75,233.16     | 0.01 |
| 26 | 601225 | 陕西煤业   | 3,771     | 70,065.18     | 0.01 |
| 27 | 001301 | 尚太科技   | 1,164     | 68,722.56     | 0.01 |
| 28 | 300979 | 华利集团   | 925       | 52,826.75     | 0.00 |
| 29 | 300973 | 立高食品   | 360       | 34,624.80     | 0.00 |
| 30 | 001215 | 千味央厨   | 295       | 19,340.20     | 0.00 |
| 31 | 603057 | 紫燕食品   | 549       | 17,277.03     | 0.00 |
| 32 | 301363 | 美好医疗   | 445       | 16,843.25     | 0.00 |
| 33 | 301366 | 一博科技   | 268       | 12,084.12     | 0.00 |
| 34 | 301176 | 逸豪新材   | 544       | 9,188.16      | 0.00 |
| 35 | 301227 | 森鹰窗业   | 284       | 8,375.16      | 0.00 |
| 36 | 301319 | 唯特偶    | 115       | 6,126.05      | 0.00 |
| 37 | 600009 | 上海机场   | 100       | 5,771.00      | 0.00 |
| 38 | 301316 | 慧博云通   | 359       | 5,140.88      | 0.00 |
| 39 | 601628 | 中国人寿   | 100       | 3,712.00      | 0.00 |
| 40 | 601336 | 新华保险   | 100       | 3,008.00      | 0.00 |
| 41 | 600019 | 宝钢股份   | 528       | 2,951.52      | 0.00 |
| 42 | 688625 | 呈和科技   | 36        | 1,761.12      | 0.00 |
| 43 | 600104 | 上汽集团   | 100       | 1,441.00      | 0.00 |
| 44 | 001979 | 招商蛇口   | 100       | 1,263.00      | 0.00 |
| 45 | 600383 | 金地集团   | 100       | 1,023.00      | 0.00 |
| 46 | 000100 | TCL 科技 | 100       | 372.00        | 0.00 |

#### 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  | 601166 | 兴业银行 | 66,967,306.81 | 2.92           |
| 2  | 600048 | 保利发展 | 64,208,678.00 | 2.80           |
| 3  | 002714 | 牧原股份 | 63,879,769.84 | 2.79           |
| 4  | 601668 | 中国建筑 | 59,514,879.00 | 2.60           |



|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5  | 600026 | 中远海能 | 55,022,073.07 | 2.40 |
| 6  | 300531 | 优博讯  | 53,689,798.98 | 2.34 |
| 7  | 600150 | 中国船舶 | 51,480,983.00 | 2.25 |
| 8  | 601975 | 招商南油 | 46,505,353.00 | 2.03 |
| 9  | 601669 | 中国电建 | 45,492,563.00 | 1.98 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 44,223,550.18 | 1.93 |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 43,952,884.00 | 1.92 |
| 12 | 000063 | 中兴通讯 | 43,045,776.47 | 1.88 |
| 13 | 600309 | 万华化学 | 42,734,174.20 | 1.86 |
| 14 | 600809 | 山西汾酒 | 38,232,503.20 | 1.67 |
| 15 | 601899 | 紫金矿业 | 36,974,639.00 | 1.61 |
| 16 | 600582 | 天地科技 | 33,793,043.00 | 1.47 |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药 | 33,497,878.00 | 1.46 |
| 18 | 600875 | 东方电气 | 32,778,434.00 | 1.43 |
| 19 | 002832 | 比音勒芬 | 32,329,780.73 | 1.41 |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 32,176,445.03 | 1.40 |

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  | 603259 | 药明康德 | 123,957,408.31 | 5.41           |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 122,084,473.43 | 5.33           |
| 3  | 603613 | 国联股份 | 86,766,459.70  | 3.79           |
| 4  | 000792 | 盐湖股份 | 63,625,918.08  | 2.78           |
| 5  | 600570 | 恒生电子 | 62,888,742.15  | 2.74           |
| 6  | 300760 | 迈瑞医疗 | 57,311,364.11  | 2.50           |
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 51,085,744.45  | 2.23           |
| 8  | 002049 | 紫光国微 | 50,833,353.49  | 2.22           |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 49,208,967.24  | 2.15           |
| 10 | 300347 | 泰格医药 | 48,451,770.82  | 2.11           |
| 11 | 603486 | 科沃斯  | 47,934,372.64  | 2.09           |
| 12 | 300438 | 鹏辉能源 | 45,090,964.96  | 1.97           |
| 13 | 002460 | 赣锋锂业 | 41,523,805.88  | 1.81           |
| 14 | 600745 | 闻泰科技 | 39,919,969.46  | 1.74           |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 36,770,330.80  | 1.60           |
| 16 | 002810 | 山东赫达 | 36,328,233.26  | 1.58           |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 36,158,468.56  | 1.58           |
| 18 | 300014 | 亿纬锂能 | 35,846,625.42  | 1.56           |
| 19 | 000568 | 泸州老窖 | 34,896,565.66  | 1.52           |
| 20 | 600703 | 三安光电 | 33,475,422.27  | 1.46           |

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 | 1,739,759,520.37 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,991,332,094.83 |

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：本基金本报告期末未持有债券。

### 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 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 | 159,950.45    |
| 2  | 应收清算款 | 13,412,918.49 |
| 3  | 应收股利  | -             |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 4 | 应收利息  | -             |
| 5 | 应收申购款 | 164,626.94    |
| 6 | 其他应收款 | 233.25        |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 13,737,729.13 |

#### 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

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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，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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构        |                |                  |                |
|--------------|---------------|--------------|----------------|------------------|----------------|
|              |               | 机构投资者        |                | 个人投资者            |                |
|              |               | 持有份额         | 占总份额比<br>例 (%) | 持有份额             | 占总份额比<br>例 (%) |
| 106,241      | 10,573.08     | 2,664,936.43 | 0.24           | 1,120,630,159.55 | 99.76          |

### 9.2 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 | 200,937.14 | 0.02         |

### 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                             | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | -                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 10~50              |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2004 年 8 月 11 日）<br>基金份额总额 | 1,085,604,444.01 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 1,414,778,821.89 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 84,104,631.47    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 375,588,357.38   |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 1,123,295,095.98 |

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。

## § 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

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。

2022 年 8 月 30 日，本基金管理人发布关于公司高级管理人员变更的公告，经本基金管理人董事会批准，公司总经理王立新先生自 2022 年 8 月 28 日起代任本基金管理人首席信息官职务。张轶先生自 2022 年 8 月 28 日起不再担任本基金管理人首席信息官职务。

2022 年 10 月 14 日，本基金管理人发布关于公司高级管理人员变更的公告，郑蓓雷女士自 2022 年 10 月 13 日起担任本基金管理人财务负责人职务，王勇先生自 2022 年 10 月 13 日起担任本基金管理人董事会秘书职务。

#### 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

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所，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 90,000.00 元。目前的审计机构已连续为本基金提供 19 年的审计服务。

## 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

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施                    | 内容   |
|-----------------------|--|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 银华基金管理股份有限公司   |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2022 年 11 月 24 日   |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国证监会北京监管局   |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函（行政监管措施）  |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 公司在内控管理、销售业务管理中，违反了《证券投资基金管理公司管理办法》（证监会令第 22 号）第四十五条、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第 175 号）第三十条第一项规定。 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司已完成整改。公司所有业务均正常开展。   |
| 其他                    | 无。   |

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金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 (%) |    |
| 第一创业 | 2      | 707,866,535.06 | 19.01            | 659,226.03 | 19.78          | -  |
| 方正证券 | 4      | 534,327,263.27 | 14.35            | 492,236.20 | 14.77          | -  |
| 东北证券 | 5      | 488,868,509.04 | 13.13            | 455,283.74 | 13.66          | -  |
| 东吴证券 | 2      | 340,219,327.56 | 9.14             | 271,275.49 | 8.14           | -  |
| 兴业证券 | 3      | 274,898,799.   | 7.38             | 256,012.36 | 7.68           | -  |

|       |   |                |      |            |      |                      |
|-------|---|----------------|------|------------|------|----------------------|
|       |   | 84             |      |            |      |                      |
| 中泰证券  | 1 | 217,255,491.29 | 5.84 | 202,329.34 | 6.07 | -                    |
| 财通证券  | 2 | 183,572,549.41 | 4.93 | 134,247.49 | 4.03 | -                    |
| 江海证券  | 1 | 141,426,691.07 | 3.80 | 131,710.80 | 3.95 | -                    |
| 海通证券  | 2 | 127,818,991.33 | 3.43 | 93,473.30  | 2.80 | -                    |
| 招商证券  | 2 | 124,551,786.09 | 3.35 | 115,994.53 | 3.48 | -                    |
| 长江证券  | 2 | 93,011,103.44  | 2.50 | 68,018.84  | 2.04 | -                    |
| 银河证券  | 1 | 91,154,166.50  | 2.45 | 84,897.34  | 2.55 | -                    |
| 东兴证券  | 3 | 76,032,436.39  | 2.04 | 70,811.42  | 2.12 | -                    |
| 民生证券  | 2 | 68,988,551.77  | 1.85 | 64,249.31  | 1.93 | -                    |
| 申万宏源  | 2 | 65,496,169.98  | 1.76 | 60,993.63  | 1.83 | -                    |
| 东方证券  | 3 | 57,980,502.00  | 1.56 | 53,996.96  | 1.62 | -                    |
| 平安证券  | 2 | 36,164,360.72  | 0.97 | 33,679.70  | 1.01 | -                    |
| 西南证券  | 4 | 31,819,728.60  | 0.85 | 29,633.74  | 0.89 | -                    |
| 华创证券  | 2 | 27,139,823.40  | 0.73 | 25,275.21  | 0.76 | -                    |
| 华融证券  | 1 | 21,193,700.00  | 0.57 | 19,736.37  | 0.59 | -                    |
| 太平洋证券 | 4 | 13,427,402.85  | 0.36 | 9,819.53   | 0.29 | -                    |
| 安信证券  | 2 | -              | -    | -          | -    | -                    |
| 长城证券  | 2 | -              | -    | -          | -    | -                    |
| 东方财富  | 2 | -              | -    | -          | -    | -                    |
| 东莞证券  | 1 | -              | -    | -          | -    | -                    |
| 光大证券  | 2 | -              | -    | -          | -    | -                    |
| 国金证券  | 2 | -              | -    | -          | -    | -                    |
| 国泰君安  | 2 | -              | -    | -          | -    | -                    |
| 国信证券  | 2 | -              | -    | -          | -    | 撤销<br>1个<br>交易<br>单元 |

|            |   |   |   |   |   |                       |
|------------|---|---|---|---|---|-----------------------|
| 红塔证券       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 华安证券       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 华宝证券       | 3 | - | - | - | - | -                     |
| 华福证券       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 华泰证券       | 3 | - | - | - | - | 撤销<br>1 个<br>交易<br>单元 |
| 瑞银证券       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 上海证券       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 天风证券       | 2 | - | - | - | - | 撤销<br>1 个<br>交易<br>单元 |
| 西部证券       | 3 | - | - | - | - | -                     |
| 中金公司       | 2 | - | - | - | - | -                     |
| 中信建投       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 中信证券       | 3 | - | - | - | - | -                     |
| 中银国际       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 广发证券       | 2 | - | - | - | - | -                     |
| 国都证券       | 2 | - | - | - | - | -                     |
| 宏信证券       | 2 | - | - | - | - | -                     |
| 华金证券       | 2 | - | - | - | - | 新增<br>2 个<br>交易<br>单元 |
| 南京证券       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 上海华信<br>证券 | 0 | - | - | - | - | 撤销<br>1 个<br>交易<br>单元 |
| 中信华南       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 湘财证券       | 1 | - | - | - | - | -                     |
| 新时代证<br>券  | 2 | - | - | - | - | -                     |
| 中原证券       | 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。

### 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(%) |
| 第一创业 | 40,014,028.00 | 66.67           | -      | -                 | -    | -               |
| 方正证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东北证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东吴证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 兴业证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 中泰证券 | 20,002,000.00 | 33.33           | -      | -                 | -    | -               |
| 财通证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 江海证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 海通证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 招商证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 长江证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 银河证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东兴证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 民生证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 申万宏源 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东方证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 平安证券 | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 西南证  | -             | -               | -      | -                 | -    | -               |



|           |   |   |   |   |   |   |
|-----------|---|---|---|---|---|---|
| 券         |   |   |   |   |   |   |
| 华创证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 华融证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 长城证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 东方财<br>富  | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 光大证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 国金证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君<br>安  | - | - | - | - | - | - |
| 国信证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 华安证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 华福证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 上海证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 天风证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 西部证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 中金公<br>司  | - | - | - | - | - | - |
| 中信建       | - | - | - | - | - | - |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 投          |   |   |   |   |   |   |
| 中信证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 中银国<br>际   | - | - | - | - | - | - |
| 广发证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 国都证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 华金证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 南京证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 上海华<br>信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信华<br>南   | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证<br>券   | - | - | - | - | - | - |
| 新时代<br>证券  | - | - | - | - | - | - |
| 中原证<br>券   | - | - | - | - | - | - |

### 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-道琼斯 88 精选证券投资基金恢复大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》 | 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报 | 2022 年 1 月 18 日 |
| 2  | 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 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 1 月 21 日 |
| 3  | 《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 1 月 21 日 |
| 4  | 《银华-道琼斯 88 精选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 1 月 28 日 |
| 5  | 《银华基金管理股份有限公司关于旗                              | 本基金管理人网站, 中                   | 2022 年 1 月 28 日 |

|    |  |                                |                  |
|----|--|--------------------------------|------------------|
|    | 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》      | 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报           |                  |
| 6  | 《银华-道琼斯 88 精选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 1 月 28 日  |
| 7  | 《银华基金管理股份有限公司关于增加厦门国际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 1 月 28 日  |
| 8  | 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 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 3 月 29 日  |
| 9  | 《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 3 月 29 日  |
| 10 | 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 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 4 月 20 日  |
| 11 | 《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 4 月 20 日  |
| 12 | 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2022 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        | 2022 年 7 月 19 日  |
| 13 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告》     | 四大证券报                          | 2022 年 7 月 19 日  |
| 14 | 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2022 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        | 2022 年 8 月 29 日  |
| 15 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年中期报告提示性公告》         | 四大证券报                          | 2022 年 8 月 29 日  |
| 16 | 《银华-道琼斯 88 精选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 9 月 23 日  |
| 17 | 《银华-道琼斯 88 精选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 9 月 23 日  |
| 18 | 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金 2022 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        | 2022 年 10 月 25 日 |
| 19 | 《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告》     | 四大证券报                          | 2022 年 10 月 25 日 |

## § 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

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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2022 年 1 月 28 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 2022 年 1 月 28 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 中国证监会核准银华-道琼斯 88 精选证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《银华-道琼斯 88 精选证券投资基金基金合同》
- 13.1.4 《银华-道琼斯 88 精选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。

### 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

2023 年 3 月 31 日