

# 银华多元机遇混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人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 所有者权益（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
8.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变 .....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华多元机遇混合型证券投资基金
基金简称	银华多元机遇混合
基金主代码	009960
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 10 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	1,483,551,781.72 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在努力控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过多元化的配置策略，积极优选全市场的投资机会，整体性布局于具有核心竞争力及比较优势的行业和公司，同时追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金的“多元机遇”，是指在不同的市场阶段采取相应的多元化投资策略，积极寻求各细分市场以及个股个券的投资机会，力争实现基金资产的稳定回报。具体可以划分为两个层次：</p> <p>首先是大类资产的配置结构多元化，即在自上而下判断相关资产风险收益特征的基础上，积极寻求各细分市场的投资机会，相应采取多元化的配置策略，合理确定股票、可转换公司债券、债券等投资工具的配置比例，并在合规的范围内、适当的时候运用衍生品工具实现套期保值，力争实现基金资产的稳定回报。</p> <p>其次是各类资产内部的应对策略多元化，即根据不同的市场环境和市场阶段，采取与之相匹配的最优投资策略，从不同维度发掘个股个券的投资机会。</p> <p>本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×20%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。

### 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 姓名	杨文辉	李申

负责人	联系电话	(010) 58163000	021-60637102
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	021-60637111
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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年 9 月 10 日（基金合同生效日） -2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	155,259,226.85	27,242,511.81
本期利润	-162,859,560.34	358,616,202.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0823	0.0754
本期加权平均净值利润率	-7.91%	7.44%
本期基金份额净值增长率	-13.83%	7.91%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-103,927,988.84	26,822,252.66
期末可供分配基金份额利润	-0.0701	0.0063

期末基金资产净值	1,379,623,792.88	4,599,650,633.02
期末基金份额净值	0.9299	1.0791
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-7.01%	7.91%

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

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

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人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	-1.72%	1.09%	-0.27%	0.62%	-1.45%	0.47%
过去六个月	-14.69%	1.29%	-7.14%	0.81%	-7.55%	0.48%
过去一年	-13.83%	1.36%	-5.79%	0.88%	-8.04%	0.48%
自基金合同生效起至今	-7.01%	1.21%	3.16%	0.85%	-10.17%	0.36%

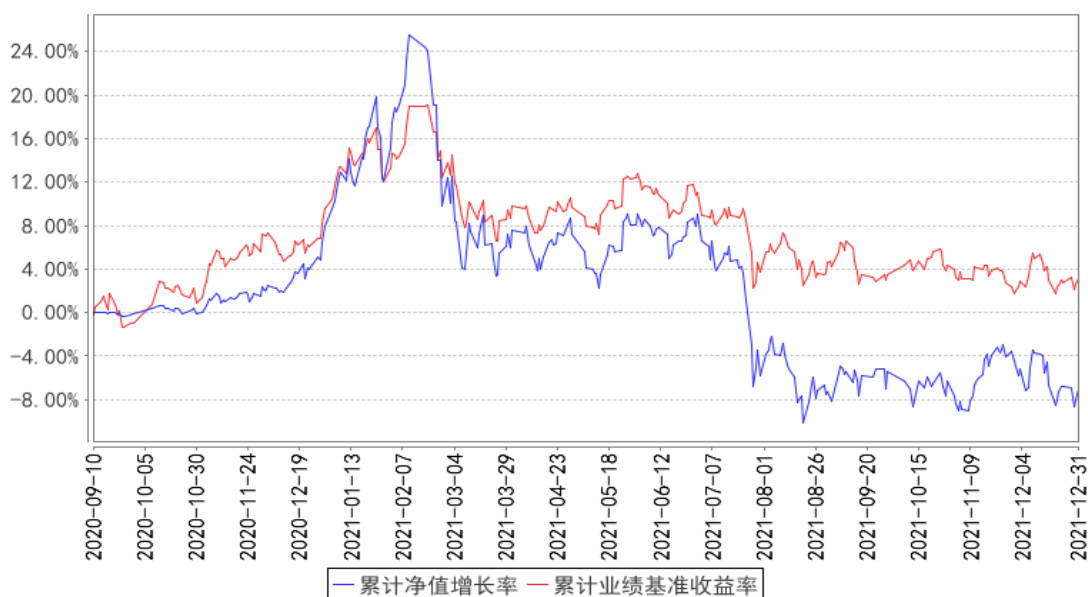
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*60%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)\*20%+中债综合指数收益率\*20%

沪深 300 指数市值覆盖率高，样本股当中集中了市场中大量优质股票，流动性好，可以成为反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”，适合作为本基金 A 股投资的比较基准。恒生指数是香港股市价格的重要指标，指数由若干只成份股（即蓝筹股）市值计算出来，代表了香港交易所所有上市公司 70%的市值，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，选样科学客观，行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，是目前市场上较有影响力的港股投资业绩比较基准，适合作为本

基金港股投资部分的业绩比较基准。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，能够综合反映债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一；该指数样本覆盖广泛，编制方法合理，样本券包括记账式国债、央行票据、短期融资券、中期票据、政策性银行债券、商业银行债券、证券公司短期融资券、证券公司债、地方企业债、国际机构债券、非银行金融机构债、中央企业债等债券。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现；指数公布透明、公开，具有较好的市场接受度。本基金是混合型基金，基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的 50%；其余资产投资于债券及其它具有高流动性的短期金融工具。总之，基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够较好的反映本基金的风险收益特征。

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

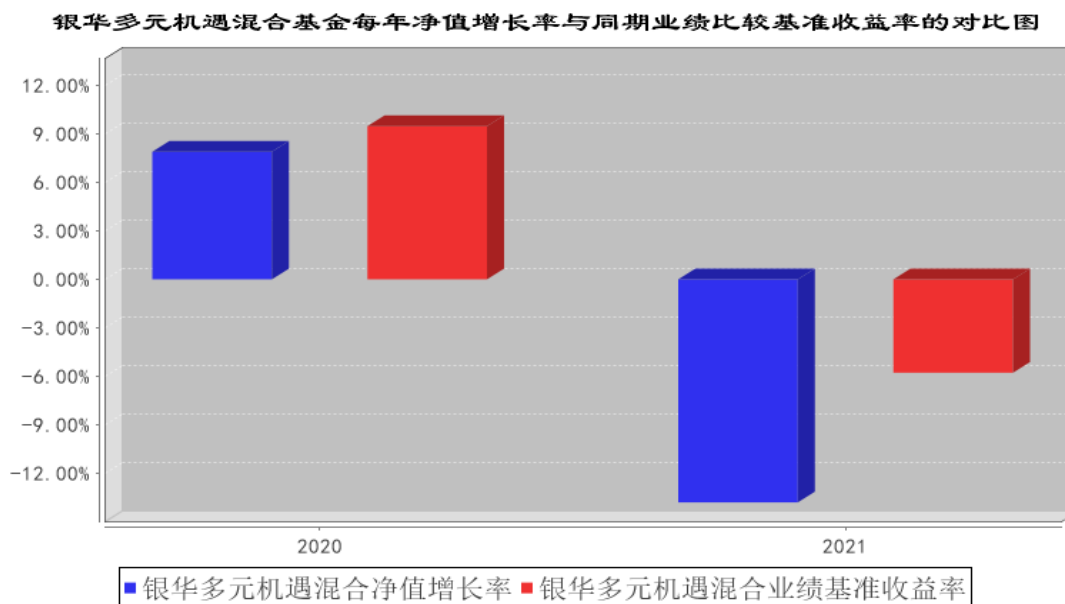
银华多元机遇混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。



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



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2021年度、2020年9月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日止会计期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人管理着 159 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选

混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投资基金 (LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金 (LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期

开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型基金中基金、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基金中基金、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。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		
贾鹏先生	本基金的基金经理	2020年9月10日	-	13.5年	硕士学位，2008年3月至2011年3月期间任职于银华基金管理有限公司，担任行业研究员职务；2011年4月至2012年3月期间任职于瑞银证券有限责任公司，担任行业研究组长；2012年4月至2014年6月期间任职于建信基金管理有限公司，担任基金经理助理。2014年6月起任职于银华基金管理有限公司，自2014年8月27日至2017年8月7日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自2014年8月27日至2016年12月22日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自2014年9月12日至2020年5月21日兼任银华增值证券投资基金基金经理，自2014年12月31日至2016年12月

					22日兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自2016年4月1日至2017年7月5日兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自2016年5月19日起兼任银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年8月8日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年12月14日起兼任银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年1月29日至2021年7月30日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2019年6月28日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自2020年1月6日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自2020年2月19日起兼任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理，自2020年9月10日起兼任银华多元机遇混合型证券投资基金基金经理，自2021年2月8日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自2021年7月15日起兼任银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
郭思先 捷生	本基金的 基金经理	2021年6 月15日	-	11.5年	硕士学位。曾就职于达科为生物科技有限公司、中国银河证券股份有限公司。2015年6月加入银华基金，历任研究部行业研究员、研究组长、投资管理三部投资经理助理、投资经理、基金经理助理，现任投资管理三部基金经理。自2020年7月29日起担任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2020年11月23日起兼任银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2021年6月15日起兼任银华多元机遇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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华多元机遇混合型证券

投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有3次,原因是量化投资组合和指数型投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2021年,全球经济共振复苏,但疫情制约犹存,大宗涨价推升通胀,海外流动性预期反复调整,不确定性的交织下大盘波动向下,唯有碳中和是贯穿全年的主线。宏观方面,经济在基数效应推动下年初见顶,但持续超预期的外需为出口提供了有力支撑,7月政治局会议也开始提及“稳增长”。但是三季度伴随“能耗双控”政策调控的加码,“拉闸限电”进一步制约生产,下行压力持续凸显,9月PMI更是跌破枯荣线,衰退预期一度成为市场交易主线,直至10月下旬专

项债发行开始明显提速，地产调控边际缓和，“双碳”政策也更加强调合理与平稳，稳增长的预期才再度回暖。流动性方面，年初美债快速拉升对 A 股形成巨大冲击，随后美联储议息信号的反复摇摆也影响全球流动性预期，国内逐步从年初的全球联动逐步走向“以我为主”，7 月与 12 月先后降准释放流动性，呵护稳增长政策发力，全年国内流动性一直保持相对宽松的稳货币状态。从市场表现看，大盘上半年“N”形波动，下半年窄幅震荡，风格上最大的特点，就是市值风格下沉与碳中和的强结构市。一方面，全球结构性通胀叠加双碳政策发力，碳中和成为贯穿全年的重要主线，而消费医药与金融地产则基本自 2 月大跌后持续弱势；另一方面，年初核心资产“抱团”瓦解后，小票挖掘诉求持续强化，全年市值风格下沉，小盘风格明显占优，中证 1000 有显著超额收益。

全年看，本基金仓位保持在较高的水平，其中港股资产占比有所下降。行业配置上，我们主要增加了低估值、稳增长的相关行业，如白酒、新能源运营等。

#### 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 0.9299 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.83%，业绩比较基准收益率为-5.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，经济工作会议对于稳增长提出了较为明确的要求，重申“以经济建设为中心”，保持经济运行在合理区间，迎接党的二十大胜利召开。从节奏上看，由于前高后低的基数，预计一季度经济压力最大，因此政策的力度也会在一季度最强，经济工作会议也提到“政策发力适度靠前”并且“适度超前开展基础设施投资”。从投资角度，我们认为需重点关注几个方向：一是在稳增长的背景下，确定持续发力的新旧基建，如建筑、新能源设备及运营，信息化建设等。二是在消费板块中，我们更关注顺周期的行业。经济活跃度的提升，叠加消费场景的回归，预计会对白酒、餐饮、出行等相关公司业绩带来拉动。三是持续关注新的科技方向，如元宇宙、智能汽车、细胞治疗等。

对于港股，我们认为经历了 21 年的大幅下挫后，2022 年有望迎来较好的布局时点。一方面较低的估值，提供了一个好的安全边际；另一方面，稳增长政策的逐步落地，港股一些政策强相关的行业也逐渐走出阴霾，整体投资者的信心有望恢复。但需要关注的一个风险点是海外的通胀走势。如果超预期，美联储货币紧缩的力度，可能会对全球流动性产生负面影响。

#### 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

本基金于本报告期末未进行利润分配。

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

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



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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，本基金未实施利润分配。

### 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	普华永道中天审字(2022)第 23557 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	银华多元机遇混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了银华多元机遇混合型证券投资基金(以下简称“银华多元机遇混合”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了银华多元机遇混合 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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。

	<p>审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华多元机遇混合，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>银华多元机遇混合的基金管理人银华基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银华多元机遇混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算银华多元机遇混合、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银华多元机遇混合的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银华多元机遇混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表</p>

	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多元机遇混合不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛 竞	周 祎
会计师事务所的地址	中国 上海市	
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银华多元机遇混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	85,561,611.53	203,242,882.76
结算备付金		2,194,410.56	110,481,845.00
存出保证金		344,285.00	6,752,356.14
交易性金融资产	7.4.7.2	1,303,569,180.66	3,620,778,931.03
其中：股票投资		1,213,418,198.26	3,349,179,230.77
基金投资		-	-
债券投资		90,150,982.40	271,599,700.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	700,000,000.00
应收证券清算款		-	237,395,737.27
应收利息	7.4.7.5	1,434,245.17	3,659,306.80
应收股利		-	208,260.59
应收申购款		-	1,159,643.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,393,103,732.92	4,883,678,963.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>

<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,697,210.79	159,285,382.83
应付赎回款		-	113,606,553.94
应付管理人报酬		1,788,381.56	6,094,712.91
应付托管费		298,063.57	1,015,785.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,476,281.03	3,629,003.02
应交税费		3.09	1,689.37
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	220,000.00	395,202.96
负债合计		13,479,940.04	284,028,330.56
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,483,551,781.72	4,262,658,256.86
未分配利润	7.4.7.10	-103,927,988.84	336,992,376.16
所有者权益合计		1,379,623,792.88	4,599,650,633.02
负债和所有者权益总计		1,393,103,732.92	4,883,678,963.58

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9299 元，基金份额总额 1,483,551,781.72 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银华多元机遇混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-105,941,819.95	391,447,218.09
1. 利息收入		4,110,362.93	26,242,061.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	775,041.65	813,270.35
债券利息收入		2,784,898.36	1,702,118.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		550,422.92	23,726,672.67
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		199,862,551.72	32,319,570.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	169,670,617.72	31,135,306.60
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,863,589.39	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	28,328,344.61	1,184,263.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-318,118,787.19	331,373,690.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	8,204,052.59	1,511,895.67
减：二、费用		56,917,740.39	32,831,015.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	31,242,772.96	22,125,649.87
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,207,128.73	3,687,608.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	20,156,248.68	6,892,154.39
5. 利息支出		57,233.82	-
其中：卖出回购金融资产支出		57,233.82	-
6. 税金及附加		105.59	216.41
7. 其他费用	7.4.7.20	254,250.61	125,386.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-162,859,560.34	358,616,202.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-162,859,560.34	358,616,202.65

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华多元机遇混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,262,658,256.86	336,992,376.16	4,599,650,633.02
二、本期经营活	-	-162,859,560.34	-162,859,560.34

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,779,106,475.14	-278,060,804.66	-3,057,167,279.80
其中：1. 基金申购款	464,631,086.89	81,244,443.30	545,875,530.19
2. 基金赎回款	-3,243,737,562.03	-359,305,247.96	-3,603,042,809.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,483,551,781.72	-103,927,988.84	1,379,623,792.88
项目	上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,805,841,545.11	-	4,805,841,545.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	358,616,202.65	358,616,202.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-543,183,288.25	-21,623,826.49	-564,807,114.74
其中：1. 基金申购款	19,310,079.92	714,030.74	20,024,110.66
2. 基金赎回款	-562,493,368.17	-22,337,857.23	-584,831,225.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者 权益(基金净值)	4,262,658,256.86	336,992,376.16	4,599,650,633.02
---------------------	------------------	----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银华多元机遇混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1119 号《关于准予银华多元机遇混合型证券投资基金注册的批复》核准,由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华多元机遇混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,804,951,815.25 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0788 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华多元机遇混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,805,841,545.11 份基金份额,其中认购资金利息折合 889,729.86 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华多元机遇混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括主板股票、中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、现金、股指期货、国债期货、股票期权等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%(投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%)。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率\*60%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)\*20%+中

债综合指数收益率\*20%。

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2020 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

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



## (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政

策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021 年 12 月 31 日	
	上年度末	
	2020 年 12 月 31 日	
活期存款	85,561,611.53	203,242,882.76
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	85,561,611.53	203,242,882.76

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,199,917,083.41	1,213,418,198.26	13,501,114.85	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	90,397,193.60	90,150,982.40	-246,211.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	90,397,193.60	90,150,982.40	-246,211.20
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,290,314,277.01	1,303,569,180.66	13,254,903.65	
项目	上年度末			
	2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	3,018,958,221.78	3,349,179,230.77	330,221,008.99	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	270,447,018.41	271,599,700.26	1,152,681.85
	银行间市场	-	-	-
	合计	270,447,018.41	271,599,700.26	1,152,681.85
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,289,405,240.19	3,620,778,931.03	331,373,690.84	

## 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

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	700,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	700,000,000.00	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	9,721.03	14,984.01
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,864.80	60,669.97
应收债券利息	1,422,488.95	3,275,373.96
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	308,059.73
应收申购款利息	-	27.84
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	170.39	191.29
合计	1,434,245.17	3,659,306.80

## 7.4.7.6 其他资产

注：无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,476,281.03	3,629,003.02
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,476,281.03	3,629,003.02

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	285,202.96
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	110,000.00
合计	220,000.00	395,202.96

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,262,658,256.86	4,262,658,256.86
本期申购	464,631,086.89	464,631,086.89
本期赎回（以“-”号填列）	-3,243,737,562.03	-3,243,737,562.03
- 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	1,483,551,781.72	1,483,551,781.72

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,822,252.66	310,170,123.50	336,992,376.16
本期利润	155,259,226.85	-318,118,787.19	-162,859,560.34
本期基金份额交易产生的变动数	-139,556,884.74	-138,503,919.92	-278,060,804.66
其中：基金申购款	29,495,178.88	51,749,264.42	81,244,443.30
基金赎回款	-169,052,063.62	-190,253,184.34	-359,305,247.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,524,594.77	-146,452,583.61	-103,927,988.84

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元



项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	402,949.93	240,078.88
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	322,383.79	563,966.00
其他	49,707.93	9,225.47
合计	775,041.65	813,270.35

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	169,670,617.72	31,135,306.60
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	169,670,617.72	31,135,306.60

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	6,970,193,190.36	970,626,754.97
减：卖出股票成本总额	6,800,522,572.64	939,491,448.37
买卖股票差价收入	169,670,617.72	31,135,306.60

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,863,589.39	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,863,589.39	-

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	297,030,627.12	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	289,847,033.51	-
减：应收利息总额	5,320,004.22	-
买卖债券差价收入	1,863,589.39	-

## 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收	28,328,344.61	1,184,263.56

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	28,328,344.61	1,184,263.56

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日
1. 交易性金融资产	-318,118,787.19	331,373,690.84
股票投资	-316,719,894.14	330,221,008.99
债券投资	-1,398,893.05	1,152,681.85
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	-318,118,787.19	331,373,690.84

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年9月10日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日
基金赎回费收入	8,106,753.50	1,457,964.42
基金转换费收入	97,299.09	6,397.12
其他	-	47,534.13
合计	8,204,052.59	1,511,895.67

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 9 月 10 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	20,156,248.68	6,892,154.39
银行间市场交易费用	-	-
合计	20,156,248.68	6,892,154.39

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 9 月 10 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	33,890.61	4,707.80
账户维护费	360.00	360.00
其他	-	400.00
证券组合费_港股通	-	9,918.61
合计	254,250.61	125,386.41

#### 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”）	基金管理人股东、基金代销机构
山西海鑫实业有限公司	基金管理人股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国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	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日） 至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
第一创业	1,915,232,489.23	16.05	319,808,345.60	6.49
东北证券	-	-	200,347,462.61	4.07
西南证券	2,833,350,437.43	23.74	831,899,245.21	16.89

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至 2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）
第一创业	55,436,598.02	19.26	20,105,290.41	7.47

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年9月10日（基金合同生效日）至 2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
第一创业	1,209,000,000.00	34.53	12,350,000,000.00	13.10
东北证券	-	-	1,730,000,000.00	1.83
西南证券	1,730,000,000.00	49.41	-	-

## 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
第一创业	1,783,647.41	17.23	109,438.17	7.41
西南证券	2,463,107.24	23.80	334,295.04	22.64
关联方名称	上年度可比期间 2020年9月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
西南证券	665,518.24	15.34	495,359.83	13.65
第一创业	297,839.92	6.87	297,839.92	8.21
东北证券	186,584.40	4.30	186,584.40	5.14

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	31,242,772.96	22,125,649.87
其中：支付销售机构的客户维护费	13,769,972.47	11,170,470.81

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年9月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,207,128.73	3,687,608.36

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

注：无。

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

注：无。

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年9月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	85,561,611.53	402,949.93	203,242,882.76	240,078.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按同业利率或约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

注：无。

## 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688211	中科微至	2021年10月18日	2022年4月26日	新股流通受限	90.20	71.32	4,501	405,990.20	321,011.32	-
688303	大全能源	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	21.49	60.51	29,546	634,943.54	1,787,828.46	-
688799	华纳药厂	2021年7月	2022年1月	新股流通受限	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41	-

		5 日	13 日							
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集	2021	2022	新股流	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-



	车辆	年 7 月 1 日	年 1 月 10 日	通受限							
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股流 通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-	
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股流 通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-	
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	新股流 通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	新股流 通受限	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-	
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股流 通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-	
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	新股流 通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-	
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股流 通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-	
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股流 通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-	
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股流 通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-	
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	新股流 通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-	
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	新股流 通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-	
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流 通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-	
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股流 通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301081	严牌股份	2021 年 10 月 13	2022 年 4 月 20 日	新股流 通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	

301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股流通受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月29日	2022年1月14日	新债流通受限	100.00	100.00	13,500	1,350,000.00	1,350,000.00	-

123135	泰林 转债	2021 年 12 月 24 日	2022 年 1 月 19 日	新债流 通受限	100.00	100.00	21,670	2,167,000.00	2,167,000.00	-
--------	----------	---------------------------	-----------------------	------------	--------	--------	--------	--------------	--------------	---

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	85,561,611.53	-	-	-	85,561,611.53
结算备付金	2,194,410.56	-	-	-	2,194,410.56
存出保证金	344,285.00	-	-	-	344,285.00
交易性金融资产	86,633,982.40	-	3,517,000.00	1,213,418,198.26	1,303,569,180.66
应收利息	-	-	-	1,434,245.17	1,434,245.17
资产总计	174,734,289.49	-	3,517,000.00	1,214,852,443.43	1,393,103,732.92
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,788,381.56	1,788,381.56
应付托管费	-	-	-	298,063.57	298,063.57
应付证券清算款	-	-	-	9,697,210.79	9,697,210.79
应付交易费用	-	-	-	1,476,281.03	1,476,281.03
应交税费	-	-	-	3.09	3.09
其他负债	-	-	-	220,000.00	220,000.00
负债总计	-	-	-	13,479,940.04	13,479,940.04
利率敏感度缺口	174,734,289.49	-	3,517,000.00	1,201,372,503.39	1,379,623,792.88
上年度末 2020 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	203,242,882.76	-	-	-	203,242,882.76
结算备付金	110,481,845.00	-	-	-	110,481,845.00
存出保证金	6,752,356.14	-	-	-	6,752,356.14
交易性金融资产	249,719,838.00	21,782,951.10	96,911.16	3,349,179,230.77	3,620,778,931.03
买入返售金融资产	700,000,000.00	-	-	-	700,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	237,395,737.27	237,395,737.27
应收利息	-	-	-	3,659,306.80	3,659,306.80
应收股利	-	-	-	208,260.59	208,260.59

应收申购款	30,500.00	-	-	1,129,143.99	1,159,643.99
资产总计	1,270,227,421.90	21,782,951.10	96,911.16	3,591,571,679.42	4,883,678,963.58
负债					
应付证券清算款	-	-	-	159,285,382.83	159,285,382.83
应付赎回款	-	-	-	113,606,553.94	113,606,553.94
应付管理人报酬	-	-	-	6,094,712.91	6,094,712.91
应付托管费	-	-	-	1,015,785.53	1,015,785.53
应付交易费用	-	-	-	3,629,003.02	3,629,003.02
应交税费	-	-	-	1,689.37	1,689.37
其他负债	-	-	-	395,202.96	395,202.96
负债总计	-	-	-	284,028,330.56	284,028,330.56
利率敏感度缺口	1,270,227,421.90	21,782,951.10	96,911.16	3,307,543,348.86	4,599,650,633.02

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	+25 个基点	-118,896.24	-538,579.24
	-25 个基点	118,896.24	538,579.24

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			合计
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的				

资产				
交易性金融资产	-	236,497,692.38	-	236,497,692.38
资产合计	-	236,497,692.38	-	236,497,692.38
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	236,497,692.38	-	236,497,692.38
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	1,145,363,995.30	-	1,145,363,995.30
交易性金融资产	-	1,145,363,995.30	-	1,145,363,995.30
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,145,363,995.30	-	1,145,363,995.30

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化率变化 5%，其他变量不变		
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	港币 5%	11,824,884.62	57,268,199.77
	港币 -5%	-11,824,884.62	-57,268,199.77

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,213,418,198.26	87.95	3,349,179,230.77	72.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	90,150,982.40	6.53	271,599,700.26	5.90
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	1,303,569,180.66	94.49	3,620,778,931.03	78.72

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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



			31 日 )
分析	业绩比较基准上升 5%	92,700,979.58	103,015,382.65
	业绩比较基准下降 5%	-92,700,979.58	-103,015,382.65

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,210,815,783.78 元，属于第二层次的余额为 90,150,982.40 元，属于第三层次的余额为 2,602,414.48 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 3,350,301,842.61 元，第二层次 270,477,088.42 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动为购买交易性金融资产-股票投资。于 2021 年 1 月 1 日，本基金未持有第三层次资产。2021 年度购买第三层次资产金额为 1,327,546.78 元，计入当期损益的利得或损失金额为 1,274,867.70 元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次资产的账面价值为 2,602,414.48 元(2020 年 12 月 31 日：无)。2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损

益的未实现利得或损失的变动金额为 1,274,867.70 元（2020 年度：无）。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,213,418,198.26	87.10
	其中：股票	1,213,418,198.26	87.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	90,150,982.40	6.47
	其中：债券	90,150,982.40	6.47
	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	87,756,022.09	6.30
8	其他各项资产	1,778,530.17	0.13
9	合计	1,393,103,732.92	100.00

注：由于四舍五入的原因，市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	8,045,471.86	0.58

C	制造业	712,562,929.07	51.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,157,082.56	1.97
E	建筑业	2,672,876.00	0.19
F	批发和零售业	26,545.52	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	19,810,257.40	1.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,184,520.63	1.83
J	金融业	81,303,819.81	5.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,603,588.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	65,713,393.92	4.76
N	水利、环境和公共设施管理业	9,359.52	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	18,830,661.59	1.36
S	综合	-	-
	合计	976,920,505.88	70.81

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	73,075,109.41	5.30
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	114,183,816.66	8.28
工业	-	-
信息技术	15,070,003.20	1.09
电信服务	26,741,145.09	1.94
公用事业	-	-
地产建筑业	7,427,618.02	0.54
合计	236,497,692.38	17.14

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	38,237	78,385,850.00	5.68
2	000858	五粮液	273,400	60,875,244.00	4.41
3	688198	佰仁医疗	236,391	60,114,231.30	4.36

4	300813	泰林生物	536,300	53,630,000.00	3.89
5	600036	招商银行	1,009,047	49,150,679.37	3.56
6	603259	药明康德	339,594	40,269,056.52	2.92
7	002304	洋河股份	239,100	39,386,943.00	2.85
8	002812	恩捷股份	133,800	33,503,520.00	2.43
9	300750	宁德时代	56,166	33,025,608.00	2.39
10	09926	康方生物-B	1,173,000	32,607,523.20	2.36
11	01951	锦欣生殖	4,230,500	30,126,642.73	2.18
12	002241	歌尔股份	525,069	28,406,232.90	2.06
13	601012	隆基股份	312,187	26,910,519.40	1.95
14	00700	腾讯控股	71,600	26,741,145.09	1.94
15	600132	重庆啤酒	173,800	26,299,416.00	1.91
16	688179	阿拉丁	322,797	25,378,300.14	1.84
17	600905	三峡能源	3,092,056	23,221,340.56	1.68
18	300973	立高食品	171,172	22,608,397.76	1.64
19	00027	银河娱乐	683,000	22,560,200.32	1.64
20	600809	山西汾酒	66,432	20,977,896.96	1.52
21	06855	亚盛医药-B	898,900	20,725,326.05	1.50
22	002179	中航光电	201,640	20,276,918.40	1.47
23	600600	青岛啤酒	204,300	20,225,700.00	1.47
24	603919	金徽酒	520,621	20,101,176.81	1.46
25	600754	锦江酒店	338,059	19,810,257.40	1.44
26	000799	酒鬼酒	91,944	19,538,100.00	1.42
27	09922	九毛九	1,637,000	18,336,233.44	1.33
28	06862	海底捞	1,245,000	17,915,251.20	1.30
29	600702	舍得酒业	78,200	17,774,860.00	1.29
30	09966	康宁杰瑞制药-B	1,517,000	16,868,069.12	1.22
31	300059	东方财富	434,480	16,123,552.80	1.17
32	002027	分众传媒	1,905,200	15,603,588.00	1.13
33	00268	金蝶国际	768,000	15,070,003.20	1.09
34	00839	中教控股	1,378,000	14,263,424.45	1.03
35	605089	味知香	144,665	13,721,475.25	0.99
36	600637	东方明珠	1,440,100	13,608,945.00	0.99
37	002271	东方雨虹	250,900	13,217,412.00	0.96
38	002460	赣锋锂业	92,355	13,192,911.75	0.96
39	002405	四维图新	725,400	11,548,368.00	0.84
40	300144	宋城演艺	786,700	11,265,544.00	0.82
41	601799	星宇股份	54,386	11,108,340.50	0.81
42	600660	福耀玻璃	221,300	10,432,082.00	0.76
43	300633	开立医疗	312,900	9,990,897.00	0.72
44	002142	宁波银行	241,063	9,227,891.64	0.67

45	002415	海康威视	154,520	8,084,486.40	0.59
46	300413	芒果超媒	131,400	7,518,708.00	0.54
47	06049	保利物业	148,200	7,427,618.02	0.54
48	300762	上海瀚讯	256,600	7,035,972.00	0.51
49	01877	君实生物	146,200	6,932,920.96	0.50
50	01801	信达生物	175,500	6,923,334.60	0.50
51	601601	中国太保	250,800	6,801,696.00	0.49
52	002850	科达利	40,542	6,500,504.28	0.47
53	603786	科博达	79,500	6,383,850.00	0.46
54	688408	中信博	36,093	6,370,775.43	0.46
55	000768	中航西飞	142,623	5,205,739.50	0.38
56	603979	金诚信	234,927	5,046,231.96	0.37
57	600893	航发动力	68,800	4,366,048.00	0.32
58	601778	晶科科技	461,400	3,935,742.00	0.29
59	002568	百润股份	56,800	3,398,344.00	0.25
60	002245	蔚蓝锂芯	100,200	2,756,502.00	0.20
61	000739	普洛药业	76,100	2,670,349.00	0.19
62	605338	巴比食品	65,400	2,278,536.00	0.17
63	002192	融捷股份	17,200	2,238,580.00	0.16
64	688303	大全能源	29,546	1,787,828.46	0.13
65	601186	中国铁建	173,100	1,350,180.00	0.10
66	601100	恒立液压	16,300	1,333,340.00	0.10
67	601669	中国电建	163,700	1,322,696.00	0.10
68	600988	赤峰黄金	51,051	760,659.90	0.06
69	688211	中科微至	4,501	321,011.32	0.02
70	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.01
71	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
72	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
73	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
74	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
75	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
76	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
77	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
78	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
79	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
80	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
81	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
82	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
83	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
84	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
85	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
86	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00

87	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
88	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
89	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
90	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
91	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
92	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
93	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
94	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
95	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
96	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
97	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
98	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
99	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
100	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
101	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
102	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
103	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
104	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
105	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
106	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
107	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
108	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
109	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
110	301068	大地海洋	144	4,086.72	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	01398	工商银行	141,596,735.01	3.08
2	00027	银河娱乐	110,762,210.79	2.41
3	000568	泸州老窖	99,906,571.08	2.17
4	00700	腾讯控股	96,004,138.31	2.09
5	000858	五粮液	90,686,491.59	1.97
6	300760	迈瑞医疗	87,990,611.00	1.91
7	601816	京沪高铁	80,814,469.00	1.76
8	002607	中公教育	79,301,523.09	1.72
9	601128	常熟银行	74,706,896.43	1.62
10	300347	泰格医药	73,573,905.40	1.60
11	600900	长江电力	73,541,185.00	1.60
12	02601	中国太保	72,152,167.82	1.57
13	00880	澳博控股	71,842,067.87	1.56

14	601012	隆基股份	69,231,340.36	1.51
15	600519	贵州茅台	66,697,617.65	1.45
16	688198	佰仁医疗	65,900,828.09	1.43
17	00135	昆仑能源	62,969,706.76	1.37
18	600132	重庆啤酒	62,347,558.87	1.36
19	300413	芒果超媒	62,172,030.23	1.35
20	600754	锦江酒店	61,691,941.91	1.34

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	01398	工商银行	287,643,819.29	6.25
2	603259	药明康德	165,218,748.91	3.59
3	600519	贵州茅台	138,695,766.02	3.02
4	00388	香港交易所	128,952,583.97	2.80
5	000858	五粮液	126,070,814.58	2.74
6	688012	中微公司	121,785,126.80	2.65
7	00027	银河娱乐	113,299,234.95	2.46
8	601318	中国平安	112,903,761.46	2.45
9	601601	中国太保	109,461,342.58	2.38
10	000001	平安银行	108,122,700.15	2.35
11	600900	长江电力	94,244,657.46	2.05
12	000568	泸州老窖	92,056,982.20	2.00
13	00880	澳博控股	87,500,001.96	1.90
14	600176	中国巨石	84,616,114.00	1.84
15	002007	华兰生物	81,982,344.01	1.78
16	01308	海丰国际	79,782,411.05	1.73
17	601899	紫金矿业	79,725,256.77	1.73
18	00700	腾讯控股	78,933,449.23	1.72
19	600036	招商银行	77,663,377.36	1.69
20	300122	智飞生物	77,121,844.29	1.68

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	4,962,905,213.20
卖出股票收入（成交）总额	6,970,193,190.36

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	86,633,982.40	6.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,517,000.00	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,150,982.40	6.53

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019654	21 国债 06	866,080	86,633,982.40	6.28
2	123135	泰林转债	21,670	2,167,000.00	0.16
3	113052	兴业转债	13,500	1,350,000.00	0.10

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一



年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	344,285.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,434,245.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,778,530.17

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
27,070	54,804.28	10,021,219.42	0.68	1,473,530,562.30	99.32

### 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	5,261,947.47	0.35

### 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、基金投资和研部	>100

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	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年9月10日） 基金份额总额	4,805,841,545.11
本报告期期初基金份额总额	4,262,658,256.86
本报告期基金总申购份额	464,631,086.89
减：本报告期基金总赎回份额	3,243,737,562.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,483,551,781.72

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

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

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 100,000.00 元。目前的审计机构已连续 2 年为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券	4	2,833,350,437.43	23.74%	2,463,107.24	23.80%	-
第一创业	2	1,915,232,489.23	16.05%	1,783,647.41	17.23%	-
招商证券	2	1,829,274,416.44	15.33%	1,463,421.80	14.14%	-
中金公司	2	881,457,326.26	7.39%	820,899.91	7.93%	-
华创证券	2	691,732,860.86	5.80%	644,502.80	6.23%	-
长江证券	2	660,164,362.61	5.53%	614,811.50	5.94%	-
方正证券	4	622,593,548.05	5.22%	461,907.91	4.46%	-
华泰证券	4	447,961,092.47	3.75%	327,592.22	3.16%	-
广发证券	2	357,985,604.10	3.00%	333,390.39	3.22%	-
申万宏源	2	294,925,461.08	2.47%	274,664.39	2.65%	-
东方证券	3	275,265,634.17	2.31%	220,213.77	2.13%	-
光大证券	2	232,830,876.43	1.95%	216,836.56	2.09%	-
天风证券	3	189,905,213.54	1.59%	148,848.39	1.44%	-
华宝证券	3	158,972,535.62	1.33%	116,256.34	1.12%	-
华福证券	1	149,087,037.53	1.25%	138,841.10	1.34%	-
安信证券	2	95,630,576.63	0.80%	89,062.13	0.86%	-
中信证券	3	85,238,918.70	0.71%	62,335.06	0.60%	-
民生证券	2	79,436,369.46	0.67%	73,978.65	0.71%	-
太平洋证券	4	66,020,532.28	0.55%	48,280.38	0.47%	-

海通证券	2	39,080,671.79	0.33%	28,581.06	0.28%	-
西部证券	3	26,952,438.88	0.23%	19,710.12	0.19%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	撤销1 个交 易单 元
东北证券	5	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
上海华信	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-

兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	新增 1 个交易单元
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
西南证券	-	-	1,730,000,000.00	49.41%	-	-
第一创业	55,436,598.02	19.26%	1,209,000,000.00	34.53%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	94,491.82	0.03%	40,000,000.00	1.14%	-	-
长江证券	148,915,245.80	51.75%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	26,119,709.30	9.08%	357,600,000.00	10.21%	-	-
广发证券	33,936,142.70	11.79%	95,000,000.00	2.71%	-	-
申万宏源	9,100,388.40	3.16%	70,000,000.00	2.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	14,168,665.20	4.92%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
上海华信	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金于本报告期末运用交易单元进行权证交易。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-1-20
2	《银华多元机遇混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-1-20
3	《银华基金管理股份有限公司关于增加度小满基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-3
4	《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-5
5	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-5
6	《银华多元机遇混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-5
7	《银华多元机遇混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-5
8	《银华多元机遇混合型证券投资基金基金合同（2021 年 2 月修订）》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-5
9	《银华多元机遇混合型证券投资基金托管协议（2021 年 2 月修订）》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-2-5
10	《银华基金管理股份有限公司关于增加腾安基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 上海证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-3-4
11	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 上海证券报, 证券时报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-3-9

12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2021-3-29
13	《银华多元机遇混合型证券投资基金 2020 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-3-29
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-3-30
15	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-4-21
16	《银华多元机遇混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-4-21
17	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-4-27
18	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-17
19	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-7
20	《银华多元机遇混合型证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-17
21	《银华多元机遇混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-17
22	《银华基金管理股份有限公司关于银华多元机遇混合型证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站, 上海证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-17
23	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资(如有)业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-28
24	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-7-19
25	《银华多元机遇混合型证券投资基金	本基金管理人网站, 中	2021-7-19



	2021 年第 2 季度报告》	国证监会基金电子披露网站	
26	《银华基金管理股份有限公司关于调整银华旗下部分基金在代销机构费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-7-23
27	《银华多元机遇混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-7-30
28	《银华多元机遇混合型证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 3 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-7-30
29	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2021-8-28
30	《银华多元机遇混合型证券投资基金 2021 年中期报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-28
31	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-14
32	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-27
33	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-10-12
34	《银华基金管理股份有限公司关于对旗下部分基金于 2021 年 10 月 13 日的申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务申请作无效处理的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-10-13
35	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-10-26
36	《银华多元机遇混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-10-26
37	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-11-22
38	《银华多元机遇混合型证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2021-12-17

		网站	
39	《银华多元机遇混合型证券投资基金招募说明书更新(2021 年第 4 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-17
40	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-17
41	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-22
42	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-28

## § 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

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

2、本基金管理人于 2021 年 12 月 17 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》，本基金自 2021 年 12 月 17 日起可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 银华多元机遇混合型证券投资基金基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 13.1.2 《银华多元机遇混合型证券投资基金招募说明书》

- 13.1.3 《银华多元机遇混合型证券投资基金基金合同》
- 13.1.4 《银华多元机遇混合型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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2022 年 3 月 29 日