

# 银华长荣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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 06 月 18 日（基金合同生效日）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	6
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本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	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>46</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
11.4 基金投资策略的改变 .....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</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 .....	59
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
13.1 备查文件目录 .....	59
13.2 存放地点 .....	60
13.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华长荣混合型证券投资基金
基金简称	银华长荣混合
基金主代码	011855
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 18 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,428,228,458.57 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握股票市场和债券市场的收益率变化，在控制风险的前提下为投资人获取稳健回报。
投资策略	<p>本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例；根据国家政治经济政策精神，确定可投资的行业范围。本基金为混合型基金，长期来看将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，适当进行短期的战术避险选择。本基金将采用“自上而下”选择细分行业及“自下而上”的方式挑选公司。在选择细分行业的时候，遵循国家政治经济政策精神，选择国家明确支持的细分行业。在这些细分行业中，针对每一个公司从定性和定量两个角度对公司进行研究，从定性的角度分析公司的核心竞争力，包括公司的产品的竞争力、管理层经营能力、治理结构、经营机制、销售模式等方面是否能构建宽广的“护城河”；从定量的角度分析公司的成长性、财务状况和估值水平等指标是否达到标准。综合来看，具有持续性核心竞争力，并且在财务质量和价值方面达到要求的公司进入本基金的基础股票组合。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%—95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 60%—95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%—50%）。其余资产投资于债券、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）、现金、股指期货等金融工具；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×10%+中证全债指数收益率×30%。

风险收益特征	本基金属于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。本基金如投资香港联合交易所上市 的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有 风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。
--------	---

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	张燕
	联系电话	(010)58163000	0755-83199084
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95555
传真		(010)58163027	0755-83195201
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特 区报业大厦 19 层	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
邮政编码		100738	518040
法定代表人		王珠林	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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 6 月 18 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-116,535,988.02
本期利润	-102,959,864.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0675
本期加权平均净值利润率	-6.99%

本期基金份额净值增长率	-6.73%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	-109,362,876.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0766
期末基金资产净值	1,332,133,457.77
期末基金份额净值	0.9327
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-6.73%

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	-1.80%	0.52%	0.98%	0.50%	-2.78%	0.02%
过去六个月	-7.41%	0.62%	-2.58%	0.66%	-4.83%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-6.73%	0.60%	-0.89%	0.65%	-5.84%	-0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*60%+中证全债指数收益率\*30%+恒生指数收益率\*10%

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证 800 指数的成份股由中证 500 指数和沪深 300 指数成份股一起构成。中债总财富指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。中证全债指数由中证指数有限公司编制，由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。恒生指数是以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股票为成份样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩计较基准能够

忠实反映本基金的风险收益特征。

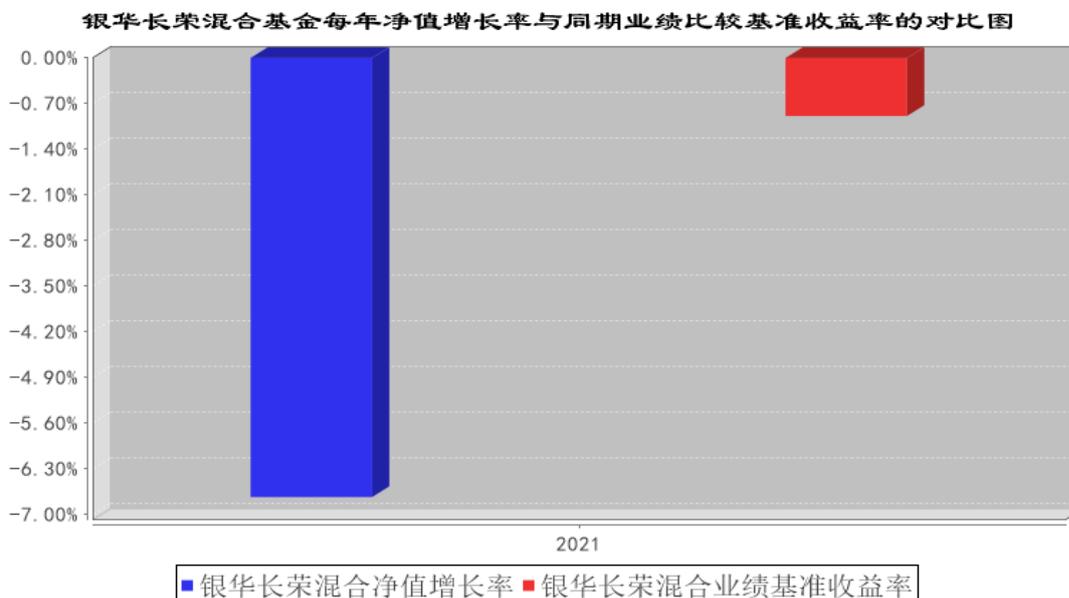
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

银华长荣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：本基金合同生效日期为 2021 年 06 月 18 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 60%–95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 60%–95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%–50%）。其余资产投资于债券、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）、现金、股指期货等金融工具；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 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6月18日（基金合同生效日）至2021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基金中基金、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		
胡银玉先生	本基金的基金经理	2021 年 6 月 18 日	-	7 年	博士学位。2014 年 8 月-2015 年 5 月加入光大证券研究所，任医药行业分析师。2015 年 6 月加入银华基金，历任研究部化工行业研究员、大宗组组长、研究主管、投资管理一部投资经理助理、投资经理，现任投资管理一部基金经理。自 2020 年 4 月 1 日起担任银华长丰混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 18 日起兼任银华长荣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、《银华长荣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

2021年,仅从各大宽基指数看,市场波动幅度不大,但行业间结构性分化较大。在1季度的春节前,市场各大指数均出现了上涨,但春节后核心资产整体出现了大幅下跌;在2季度,大部分核心资产超跌反弹,这个阶段市场开始强调企业短期的利润增速;在3季度,市场出现了剧烈

分化，回头看这是决定公募基金收益率最重要的几个月，前几年强势的医药和食品饮料都在这个阶段迎来了大幅下跌，而新能源和半导体等增速较快的新兴行业出现了强势上涨，同时“双碳”背景下部分周期品也迎来了可观的涨幅；在 4 季度，市场大部分行业的表现开始趋于平淡，元宇宙等少数题材较为突出。

回顾 2021 年，市场关注的是成长性，尤其是短期的业绩增长。客观来说，这对我们强调估值和性价比的投资策略，形成了较大的挑战。我们认为，市场强调企业的成长性这个大方向是合理的，但是部分标的在超出了合理估值区间的情况下，由于短期业绩增速快而线性外推，并继续获得大幅上涨，这时候再介入可能已经不是很好的投资选择。

本产品自成立以来，主要配置方向是消费、医药和金融，前两者自产品刚成立就出现了板块的系统性下跌，金融股由于缺乏 2021 年市场追捧的高成长性而表现一般。在 2021 年下半年，我们曾经尝试配置了一些高景气度的品种，比如新能源方向，但这些资产由于配置的初衷是跟上市场公募基金的节奏，并非是企业价值有很强的吸引力，回头来看这些资产在 4 季度的表现并不理想。这部分品种的投资我们后来反思比较多，股票价格长期来看是称重机，如果股价已经大幅超过了内在价值，就要引起警惕，任何时候还是要把个股的估值和景气度有机结合起来。

基于以上的一些思考，在 2021 年末的行业配置中，我们继续采取了均衡的思路，并确立以自下而上选择优质个股为核心的方针，适当弱化行业，强调寻找企业内在价值被低估的品种。

#### 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 0.9327 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.73%，业绩比较基准收益率为-0.89%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年 12 月，中央经济工作会议对经济形势进行了科学分析，会议立足我国国情，在继续坚持双循环、双碳、房地产调控等结构性调整政策的同时，对部分领域结构性政策进行了纠偏，防止中长期结构调整对短期经济增长带来过大压力，并明确了政策稳增长的大基调。因此，管理人认为，2022 年国内宏观经济继续向好的大方向是值得期待的。如果放眼到全球，2022 年一个值得关注的因素是海外主要经济体的货币政策，这些经济体由于通胀的压力，可能被迫加息收缩流动性，或对全球的宏观经济复苏带来一定的影响。

对于 2022 年的资本市场，我们判断市场的主基调可能是价值回归。由于国内宏观经济趋势相对明确，我们判断仍然存在 2022 年存在结构性机会，这些机会一方面可能来自于不少优秀企业内在价值的增长，还可能来自市场过去几年的偏见导致部分资产被系统性低估，他们存在价值被重估的机会。而对于过去几年股价大幅上涨，尤其是涨幅远超过企业盈利增长的企业，我们总体保

持谨慎的态度。

在消费板块，我们看好高端白酒，这部分资产的盈利稳定性和持续性目前来看仍然有很强的确定性。由于 2021 年高端白酒普遍处于调整的节奏，其估值在一定程度上得到了消化，因此高端白酒仍然是产品的重点关注方向。在消费品中，我们新增关注的是家电行业，该行业在 2021 年表现不佳，主要的压力来自于原材料价格的上涨，我们判断这部分压力在 2022 年会得到显著释放，叠加 2022 年稳增长的预期，预计家电行业的价值有可能得到重估。

在医药板块，我们关注的是一些过去被市场忽略的品种。过去几年尤其是 2021 年，公募基金在医药行业的配置普遍集中在 CXO 板块上，而我们由于强调买入的估值要相对合理，所以在该 CXO 板块的配置一直相对较少。目前这个位置，CXO 总体估值已经不便宜，而一些其他子板块比如消费医疗、中药、商业等出现了不少低估的品种，我们认为这些低估子板块会有不错的投资机会。

在金融板块，我们看好银行业。中证银行指数 2015-2020 年的涨幅仅约为 4%，远远落后于行业的收入和利润的增速。同时，无论从横向还是纵向对比，银行板块的 PE 均处于历史极低的位置，甚至放眼全球的资本市场，国内的银行也是估值的洼地。市场对银行板块的偏见，一定程度来自于地产类企业债务的短期负面影响，但是这些不利的因素，已经在股价中有了相对充分的反映。在 2022 年经济稳增长的大背景下，我们判断银行的资产质量有望得到进一步改善，从而带动银行价值的重估。

在高端制造业领域，我们会保持关注，尤其是一些未被市场充分挖掘但具有较大发展空间子行业，会是我们重点关注的方向，比如工业机床、化工新材料等。对于在 2021 年表现强势的新能源和半导体等新兴行业，我们将以观察为主，一是加大对这些新兴产业的学习和理解，二是加强对一些行业数据的跟踪，判断这些产业的景气度是否能持续超预期，如果景气度继续改善且估值相对合理，这些新兴产业也会是关注的方向。

对于基建和地产等板块，我们认为 2022 年可能也存在估值修复的机会，一方面是不少企业的价值被市场长期忽视，股票价格总体呈低估的状态，同时在稳增长的大基调下，这些行业的需求端可能迎来一些新的增量，有助于企业盈利的进一步改善。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本基金管理人始终坚持以法律法规及公司制度为基础，不断查缺补漏，确保本基金的安全、

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行基金利润分配。

#### 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职

责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

## 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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 23552 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	银华长荣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>我们审计了银华长荣混合型证券投资基金(以下简称“银华长荣混合”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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,公允反映了银华长荣混合 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于银华长荣混</p>

	合，并履行了职业道德方面的其他责任。
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>银华长荣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长荣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长荣混合、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长荣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，就可能对银华长荣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长荣混合不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	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 03 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：银华长荣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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	156,892,069.01
结算备付金		33,796,391.88
存出保证金		747,847.84
交易性金融资产	7.4.7.2	852,327,075.05
其中：股票投资		852,327,075.05
基金投资		-
债券投资		-
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	308,700,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	95,550.00
应收股利		-
应收申购款		167,653.01
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,352,726,586.79
<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>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		14,415,511.66

应付赎回款		1,776,338.15
应付管理人报酬		1,739,634.06
应付托管费		289,939.00
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	2,265,134.53
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	106,571.62
负债合计		20,593,129.02
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,428,228,458.57
未分配利润	7.4.7.10	-96,095,000.80
所有者权益合计		1,332,133,457.77
负债和所有者权益总计		1,352,726,586.79

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9327 元，基金份额总额 1,428,228,458.57 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 6 月 18 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：银华长荣混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 6 月 18 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		-79,397,559.83
1. 利息收入		7,295,955.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	869,516.23
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		6,426,439.66
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-100,603,246.57
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-102,546,863.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-

资产支持证券投资收益		-
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	1,943,617.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	13,576,124.01
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	333,606.84
减：二、费用		23,562,304.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	11,868,066.61
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,978,011.19
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	9,596,540.98
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	119,685.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-102,959,864.01
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-102,959,864.01

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华长荣混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 6 月 18 日（基金合同生效日）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）	1,565,976,460.66	-	1,565,976,460.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-102,959,864.01	-102,959,864.01
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）	-137,748,002.09	6,864,863.21	-130,883,138.88
其中：1. 基金申购款	11,871,972.48	-612,138.51	11,259,833.97
2. 基金赎回款	-149,619,974.57	7,477,001.72	-142,142,972.85

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）	1,428,228,458.57	-96,095,000.80	1,332,133,457.77

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

银华长荣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[2021]746号《关于准予银华长荣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《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金契约型开放式,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1,565,676,460.65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(2021)第0610号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》于2021年6月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,565,976,460.66份基金份额,其中认购资金利息折合300,000.01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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括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、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）。其余资产投资于债券、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）、现金、股指期货等金融工具；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×10%+中证全债指数收益率×30%。

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》、《银华长荣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 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的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 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

##### 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

#### (1) 金融资产的分类

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

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 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

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 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
活期存款	156,892,069.01
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	156,892,069.01

##### 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	838,750,951.04	852,327,075.05	13,576,124.01
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	838,750,951.04	852,327,075.05	13,576,124.01

##### 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	308,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	308,700,000.00	-

## 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
应收活期存款利息	15,629.37
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	16,729.24
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	62,821.13
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	370.26
合计	95,550.00

## 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
交易所市场应付交易费用	2,265,134.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,265,134.53

## 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,571.62
应付证券出借违约金	-
预提费用	100,000.00
合计	106,571.62

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,565,976,460.66	1,565,976,460.66
本期申购	11,871,972.48	11,871,972.48
本期赎回（以“-”号填列）	-149,619,974.57	-149,619,974.57
- 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	1,428,228,458.57	1,428,228,458.57

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2021 年 6 月 2 日至 2021 年 6 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,565,676,460.65 元，折合为 1,565,676,460.65 份基金份额。根据《银华长荣混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 300,000.01 元在本基金成立后，折合为 300,000.01 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》、《银华长荣混合型证券投资基金招募说明书》及《银华长荣混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》的相关规定，本基金于 2021 年 6 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 9 月 16 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、定期定额投资、赎回和转换业务自 2021 年 9 月 17 日起开始办理。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-116,535,988.02	13,576,124.01	-102,959,864.01
本期基金份额交易产生的变动数	7,173,111.95	-308,248.74	6,864,863.21
其中：基金申购款	-627,692.81	15,554.30	-612,138.51
基金赎回款	7,800,804.76	-323,803.04	7,477,001.72
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-109,362,876.07	13,267,875.27	-96,095,000.80
-----	-----------------	---------------	----------------

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
活期存款利息收入		620,492.01
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		244,944.40
其他		4,079.82
合计		869,516.23

#### 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6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-102,546,863.94
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		-102,546,863.94

##### 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6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
卖出股票成交总额		3,251,649,983.67
减：卖出股票成本总额		3,354,196,847.61
买卖股票差价收入		-102,546,863.94

##### 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

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6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,943,617.37
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	1,943,617.37

**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6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	13,576,124.01
股票投资	13,576,124.01
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	13,576,124.01

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	260,858.04
基金转换费收入	72,662.94
其他	85.86
合计	333,606.84

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	9,596,540.98
银行间市场交易费用	-
合计	9,596,540.98

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	100,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	10,050.75
其他	9,634.65
合计	119,685.40

## 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

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东
山西海鑫实业有限公司	基金管理人股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
银华长安资本管理(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：下述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6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
西南证券	398,594,428.73	5.38

## 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

## 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6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
西南证券	303,900,000.00	0.97

## 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6月18日（基金合同生效日）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（%）
西南证券	302,718.39	5.57	112,421.35	4.96

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 2021年6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的管理费	11,868,066.61	
其中：支付销售机构的客户维护费	5,746,089.85	

注：支付基金管理人银华基金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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	1,978,011.19	

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

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

### 7.4.10.3 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6月18日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行——活期存款	156,892,069.01	620,492.01

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
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	-
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	2021年	2022年	新股流	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-

	规院	7月22日	2月7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02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	-
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	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
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	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
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 日	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	-
301098	金埔园林	2021年 11月4 日	2022年 5月12 日	新股流 通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
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	-
688071	华依科技	2021年 7月21 日	2022年 2月7 日	新股流 通受限	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
688255	凯尔达	2021年 10月14 日	2022年 4月25 日	新股流 通受限	47.11	37.87	1,648	77,637.28	62,409.76	-
688622	禾信仪器	2021年 9月3 日	2022年 3月14 日	新股流 通受限	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
688739	成大生物	2021年 10月21 日	2022年 4月28 日	新股流 通受限	110.00	70.32	6,917	760,870.00	486,403.44	-
688772	珠海冠宇	2021年 9月30 日	2022年 4月15 日	新股流 通受限	14.43	39.09	12,960	187,012.80	506,606.40	-

		日	日							
--	--	---	---	--	--	--	--	--	--	--

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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	156,892,069.01	-	-	-	156,892,069.01
结算备付金	33,796,391.88	-	-	-	33,796,391.88
存出保证金	747,847.84	-	-	-	747,847.84
交易性金融资产	-	-	-	-852,327,075.05	852,327,075.05
买入返售金融资产	308,700,000.00	-	-	-	308,700,000.00
应收利息	-	-	-	95,550.00	95,550.00
应收申购款	-	-	-	167,653.01	167,653.01
<b>资产总计</b>	<b>500,136,308.73</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-852,590,278.06</b>	<b>1,352,726,586.79</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,776,338.15	1,776,338.15
应付管理人报酬	-	-	-	1,739,634.06	1,739,634.06
应付托管费	-	-	-	289,939.00	289,939.00
应付证券清算款	-	-	-	14,415,511.66	14,415,511.66
应付交易费用	-	-	-	2,265,134.53	2,265,134.53
其他负债	-	-	-	106,571.62	106,571.62
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>20,593,129.02</b>	<b>20,593,129.02</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>500,136,308.73</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-831,997,149.04</b>	<b>1,332,133,457.77</b>

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

##### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末（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资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	2,459,299.02	-	2,459,299.02
资产合计	-	2,459,299.02	-	2,459,299.02
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	2,459,299.02	-	2,459,299.02

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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

##### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	852,327,075.05	63.98
交易性金融资产—基金投资	—	—
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	852,327,075.05	63.98

## 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）
分析	业绩比较基准上升 5%	48,367,073.46
	业绩比较基准下降 5%	-48,367,073.46

注：本期财务报表的实际编制期间为本基金合同生效日至本报告期末。

## 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 850,790,237.59 元，属于第二层次的余额为 5,504.49 元，属于第三层次的余额为 1,531,332.97 元。

(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 6 月 18 日(基金合同生效日)，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 1,258,403.39 元，计入当期损益的利得或损失金额为 272,929.58 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 1,531,332.97 元。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 272,929.58 元。

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。

(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	852,327,075.05	63.01
	其中：股票	852,327,075.05	63.01
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	308,700,000.00	22.82
	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	190,688,460.89	14.10
8	其他各项资产	1,011,050.85	0.07
9	合计	1,352,726,586.79	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	1,091,488.00	0.08
B	采矿业	9,820.00	0.00
C	制造业	528,618,213.88	39.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	408,870.00	0.03
E	建筑业	25,958,179.99	1.95
F	批发和零售业	1,366,697.52	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	23,611,234.00	1.77
H	住宿和餐饮业	1,345,077.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,467,041.15	0.11
J	金融业	242,741,290.59	18.22
K	房地产业	23,169,702.00	1.74
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	61,275.36	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,409.26	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	8,477.28	0.00
S	综合	-	-
	合计	849,867,776.03	63.80

### 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	31,681.10	0.00
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	2,427,617.92	0.18
公用事业	-	-
地产建筑业	-	-
合计	2,459,299.02	0.18

### 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	55,869	114,531,450.00	8.60
2	601398	工商银行	19,833,198	91,827,706.74	6.89
3	601988	中国银行	22,513,001	68,664,653.05	5.15
4	000568	泸州老窖	247,700	62,883,599.00	4.72
5	000423	东阿阿胶	800,748	39,036,465.00	2.93
6	000858	五粮液	152,120	33,871,039.20	2.54
7	000333	美的集团	417,600	30,823,056.00	2.31
8	000661	长春高新	105,535	28,642,199.00	2.15
9	000538	云南白药	265,200	27,753,180.00	2.08
10	300083	创世纪	1,935,418	27,637,769.04	2.07
11	601288	农业银行	8,775,300	25,799,382.00	1.94
12	601658	邮储银行	5,048,888	25,749,328.80	1.93
13	601668	中国建筑	4,659,400	23,297,000.00	1.75
14	300994	久祺股份	429,220	20,438,545.00	1.53
15	600690	海尔智家	627,200	18,747,008.00	1.41
16	601939	建设银行	3,060,600	17,935,116.00	1.35
17	600048	保利发展	893,000	13,957,590.00	1.05
18	601816	京沪高铁	2,249,400	10,864,602.00	0.82
19	600887	伊利股份	226,200	9,378,252.00	0.70

20	000002	万 科 A	466,200	9,212,112.00	0.69
21	300853	申昊科技	189,210	7,852,215.00	0.59
22	002352	顺丰控股	96,600	6,657,672.00	0.50
23	601169	北京银行	1,493,100	6,629,364.00	0.50
24	000651	格力电器	176,500	6,535,795.00	0.49
25	601006	大秦铁路	951,400	6,088,960.00	0.46
26	002475	立讯精密	116,500	5,731,800.00	0.43
27	600436	片仔癀	12,400	5,420,660.00	0.41
28	002600	领益智造	674,806	4,966,572.16	0.37
29	002241	歌尔股份	86,400	4,674,240.00	0.35
30	601636	旗滨集团	235,700	4,030,470.00	0.30
31	000338	潍柴动力	217,500	3,891,075.00	0.29
32	300124	汇川技术	56,400	3,869,040.00	0.29
33	300476	胜宏科技	124,761	3,774,020.25	0.28
34	300014	亿纬锂能	31,483	3,720,660.94	0.28
35	000650	仁和药业	358,900	3,344,948.00	0.25
36	600346	恒力石化	144,700	3,323,759.00	0.25
37	002179	中航光电	31,200	3,137,472.00	0.24
38	002493	荣盛石化	160,800	2,920,128.00	0.22
39	002271	东方雨虹	53,700	2,828,916.00	0.21
40	002840	华统股份	160,000	2,764,800.00	0.21
41	002594	比亚迪	10,238	2,745,012.56	0.21
42	600585	海螺水泥	68,100	2,744,430.00	0.21
43	600085	同仁堂	60,300	2,712,294.00	0.20
44	601233	桐昆股份	126,100	2,670,798.00	0.20
45	600309	万华化学	26,300	2,656,300.00	0.20
46	601186	中国铁建	339,700	2,649,660.00	0.20
47	002821	凯莱英	5,800	2,523,000.00	0.19
48	600030	中信证券	93,200	2,461,412.00	0.18
49	00700	腾讯控股	6,500	2,427,617.92	0.18
50	600837	海通证券	188,800	2,314,688.00	0.17
51	600031	三一重工	96,200	2,193,360.00	0.16
52	300274	阳光电源	14,500	2,114,100.00	0.16
53	300870	欧陆通	20,500	1,717,080.00	0.13
54	600038	中直股份	17,700	1,421,310.00	0.11
55	603833	欧派家居	9,500	1,401,250.00	0.11
56	002311	海大集团	19,100	1,400,030.00	0.11
57	000059	华锦股份	188,900	1,375,192.00	0.10
58	601211	国泰君安	76,000	1,359,640.00	0.10
59	600703	三安光电	36,000	1,352,160.00	0.10
60	600258	首旅酒店	51,300	1,340,469.00	0.10
61	002419	天虹股份	213,400	1,340,152.00	0.10

62	600801	华新水泥	67,900	1,310,470.00	0.10
63	600879	航天电子	150,300	1,238,472.00	0.09
64	300896	爱美客	2,200	1,179,442.00	0.09
65	300596	利安隆	24,300	1,087,668.00	0.08
66	002124	天邦股份	161,200	1,038,128.00	0.08
67	605268	王力安防	80,500	1,032,815.00	0.08
68	002507	涪陵榨菜	27,200	1,028,160.00	0.08
69	000420	吉林化纤	188,084	991,202.68	0.07
70	600528	中铁工业	113,300	930,193.00	0.07
71	002368	太极股份	33,300	917,082.00	0.07
72	300911	亿田智能	10,900	892,928.00	0.07
73	300750	宁德时代	1,000	588,000.00	0.04
74	000895	双汇发展	18,600	586,830.00	0.04
75	603000	人民网	37,100	534,982.00	0.04
76	688772	珠海冠宇	12,960	506,606.40	0.04
77	600566	济川药业	17,200	487,448.00	0.04
78	688739	成大生物	6,917	486,403.44	0.04
79	000685	中山公用	46,200	408,870.00	0.03
80	300737	科顺股份	19,500	316,875.00	0.02
81	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.01
82	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.01
83	688255	凯尔达	1,648	62,409.76	0.00
84	002714	牧原股份	1,000	53,360.00	0.00
85	02331	李宁	454	31,681.10	0.00
86	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
87	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
88	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
89	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
90	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
91	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
92	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
93	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
94	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
95	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
96	601857	中国石油	2,000	9,820.00	0.00
97	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
98	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
99	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
100	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
101	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
102	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
103	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00

104	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
105	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
106	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
107	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
108	600276	恒瑞医药	123	6,237.33	0.00
109	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
110	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
111	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
112	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
113	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
114	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
115	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
116	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
117	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
118	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
119	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
120	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
121	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
122	300070	碧水源	146	1,049.74	0.00
123	600315	上海家化	8	323.28	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	159,786,206.03	11.99
2	601398	工商银行	153,051,303.42	11.49
3	300750	宁德时代	109,476,466.40	8.22
4	000661	长春高新	108,815,930.54	8.17
5	603259	药明康德	92,135,847.03	6.92
6	000858	五粮液	84,387,089.14	6.33
7	601012	隆基股份	81,542,275.58	6.12
8	603612	索通发展	77,986,071.55	5.85
9	000568	泸州老窖	77,159,764.96	5.79
10	600988	赤峰黄金	73,430,519.33	5.51
11	601988	中国银行	69,275,073.07	5.20
12	600309	万华化学	66,863,887.96	5.02
13	000423	东阿阿胶	54,605,534.32	4.10
14	600809	山西汾酒	49,376,122.88	3.71
15	300347	泰格医药	48,136,958.54	3.61
16	300806	斯迪克	47,851,043.92	3.59
17	000538	云南白药	44,272,498.97	3.32

18	601658	邮储银行	43,767,098.97	3.29
19	000333	美的集团	43,603,551.68	3.27
20	002415	海康威视	42,776,485.85	3.21
21	300083	创世纪	42,700,880.00	3.21
22	603681	永冠新材	42,643,568.72	3.20
23	600779	水井坊	37,497,017.12	2.81
24	688050	爱博医疗	37,173,851.02	2.79
25	603303	得邦照明	36,004,486.37	2.70
26	300073	当升科技	35,890,433.62	2.69
27	300015	爱尔眼科	34,925,532.78	2.62
28	600438	通威股份	33,071,147.74	2.48
29	000001	平安银行	32,914,914.00	2.47
30	002304	洋河股份	30,124,321.00	2.26
31	601668	中国建筑	29,318,512.00	2.20
32	02331	李宁	29,127,278.43	2.19
33	002594	比亚迪	29,100,794.00	2.18
34	300124	汇川技术	28,664,843.00	2.15
35	300896	爱美客	28,115,719.60	2.11
36	600690	海尔智家	27,781,023.48	2.09
37	600577	精达股份	27,552,243.32	2.07
38	600887	伊利股份	27,086,741.79	2.03
39	00700	腾讯控股	26,900,658.71	2.02

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	111,090,500.95	8.34
2	603259	药明康德	78,737,768.86	5.91
3	601012	隆基股份	78,365,803.93	5.88
4	603612	索通发展	76,587,514.22	5.75
5	600988	赤峰黄金	73,337,966.34	5.51
6	000661	长春高新	68,895,199.86	5.17
7	600309	万华化学	67,044,357.74	5.03
8	300806	斯迪克	63,782,435.05	4.79
9	601398	工商银行	58,413,756.63	4.38
10	603681	永冠新材	52,052,621.71	3.91
11	600519	贵州茅台	48,605,030.24	3.65
12	000858	五粮液	44,326,574.25	3.33
13	600809	山西汾酒	42,038,172.41	3.16
14	300347	泰格医药	40,278,595.89	3.02
15	002415	海康威视	39,625,592.06	2.97

16	600779	水井坊	39,394,894.82	2.96
17	300073	当升科技	35,414,388.96	2.66
18	603303	得邦照明	34,836,999.02	2.62
19	600438	通威股份	32,333,829.70	2.43
20	300015	爱尔眼科	30,702,544.26	2.30
21	600063	皖维高新	30,094,909.54	2.26
22	688050	爱博医疗	29,637,687.83	2.22
23	000001	平安银行	29,590,095.44	2.22
24	002304	洋河股份	28,898,694.28	2.17
25	02331	李宁	28,356,247.03	2.13
26	300850	新强联	28,318,296.95	2.13
27	600577	精达股份	26,714,898.55	2.01

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	4,178,107,107.89
卖出股票收入（成交）总额	3,251,649,983.67

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 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	747,847.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	95,550.00
5	应收申购款	167,653.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,011,050.85

### 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，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 (%)
18,701	76,371.77	-	0.00	1,428,228,458.57	100.00

**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	4,951,136.93	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 究部门负责人持有本开放式基金	>100
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（2021年6月18日） 基金份额总额	1,565,976,460.66
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	11,871,972.48
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	149,619,974.57
基金合同生效日起至报告期期末基金 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	1,428,228,458.57

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§ 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**

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

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。目前的审计机构首次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	
中信建投	4	1,332,754,102.86	17.99%	974,651.78	17.93%	-
开源证券	2	1,210,638,547.88	16.35%	885,340.48	16.28%	-
中金公司	4	1,099,147,077.80	14.84%	803,806.97	14.78%	-
海通证券	2	661,181,606.09	8.93%	483,523.01	8.89%	-
德邦证券	2	632,697,308.20	8.54%	462,689.04	8.51%	-
东吴证券	2	556,472,715.01	7.51%	406,952.41	7.48%	-
西南证券	4	398,594,428.73	5.38%	302,718.39	5.57%	-
华龙证券	2	384,366,298.49	5.19%	281,087.81	5.17%	-
华泰证券	4	285,419,481.39	3.85%	217,899.88	4.01%	-
华西证券	4	256,049,530.16	3.46%	187,252.49	3.44%	-
国信证券	2	174,779,317.91	2.36%	127,815.29	2.35%	-
东方证券	2	165,450,405.00	2.23%	120,994.37	2.23%	-
长江证券	4	104,328,502.64	1.41%	76,295.59	1.40%	-
川财证券	2	66,230,703.50	0.89%	48,434.37	0.89%	-
中泰证券	2	57,700,799.40	0.78%	42,196.99	0.78%	-
天风证券	2	14,019,754.40	0.19%	10,251.43	0.19%	-

国盛证券	2	6,775,317.38	0.09%	5,420.24	0.10%	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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
中信建投	-	-	4,780,700,000.00	15.33%	-	-
开源证券	-	-	13,013,000,000.00	41.72%	-	-
中金公司	-	-	5,060,900,000.00	16.23%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	3,433,500,000.00	11.01%	-	-
东吴证券	-	-	1,987,100,000.00	6.37%	-	-
西南证券	-	-	303,900,000.00	0.97%	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

华西证券	-	-	1,168,500,000.00	3.75%	-	-
国信证券	-	-	1,173,900,000.00	3.76%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	269,200,000.00	0.86%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	《银华长荣混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告》	中国证券报	2021-5-18
2	《银华长荣混合型证券投资基金基金份额发售公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-18
3	《银华长荣混合型证券投资基金基金产品资料概要》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-18
4	《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-18
5	《银华长荣混合型证券投资基金托管协议》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-18
6	《银华长荣混合型证券投资基金招募说明书》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-18
7	《银华基金管理股份有限公司关于银华长荣混合型证券投资基金增加代销	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会	2021-6-1

	机构的公告》	基金电子披露网站	
8	《银华基金管理股份有限公司关于银华长荣混合型证券投资基金增加中国建设银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-2
9	《银华基金管理股份有限公司关于银华长荣混合型证券投资基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-3
10	《银华基金管理股份有限公司关于银华长荣混合型证券投资基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-15
11	《银华基金管理股份有限公司关于银华长荣混合型证券投资基金基金合同生效的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-19
12	《银华长荣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	2021-6-22
13	《银华长荣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	2021-6-22
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-6-22
15	《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
16	《银华基金管理股份有限公司关于增加腾安基金销售(深圳)有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 三大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-12
17	《银华长荣混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-15
18	《银华基金管理股份有限公司关于增加国泰君安证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-22
19	《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
20	《银华长荣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
21	《银华基金管理股份有限公司关于增	本基金管理人网站, 四	2021-11-2

	加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	
22	《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, 中国证券报, 证券时报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-14

## § 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 6 月 22 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

2、本基金管理人于 2021 年 9 月 17 日披露了《银华长荣混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》，本基金自 2021 年 9 月 15 日起开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 银华长荣混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 13.1.2 《银华长荣混合型证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《银华长荣混合型证券投资基金基金合同》
- 13.1.4 《银华长荣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