

# 银华核心价值优选混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
<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 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	23
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华核心价值优选混合型证券投资基金
基金简称	银华价值优选混合
基金主代码	519001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 9 月 27 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	1,121,755,303.49 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司,同时通过优化风险收益配比以获取超额收益,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	在价值创造主导的投资理念指导下,本基金的投资策略以自下而上的股票精选为主,同时也通过辅助性的主动类别资产配置,在投资组合中加入债券资产以降低整个资产组合的系统性风险。本基金充分发挥“自下而上”的主动选股能力,通过定量的业绩归因分析深入发掘主动性回报的相关信息,适当加大选股因素的贡献度,借助投资组合优化技术实现投资风险与收益的最佳配比。 本基金的具体投资比例如下:股票投资比例浮动范围:60%-95%;除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为5%-40%,其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于5%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,其与预期收益和预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金力争在控制风险的前提之下,使基金的长期收益水平高于业绩比较基准。

### 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 负责人	姓名	杨文辉
	联系电话	(010)58163000
	电子邮箱	yhj@yhfund.com.cn
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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-415,562,620.88
本期利润	-446,278,342.99
加权平均基金份额本期利润	-0.3961
本期加权平均净值利润率	-14.66%
本期基金份额净值增长率	-12.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	2,805,548,023.36
期末可供分配基金份额利润	2.5010
期末基金资产净值	3,152,558,731.05
期末基金份额净值	2.8104
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	981.13%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

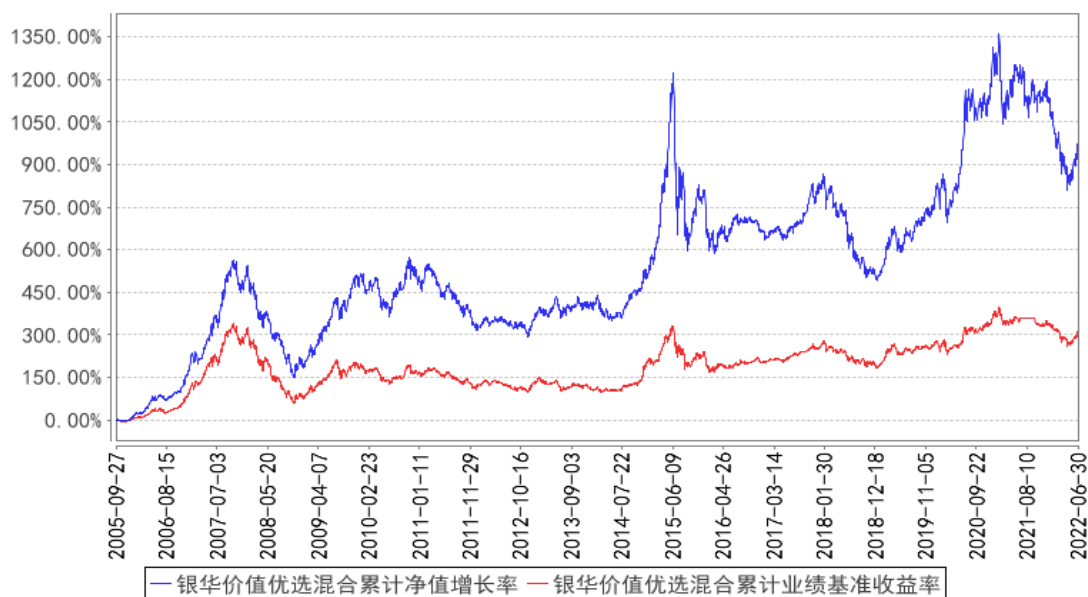
过去一个月	9.49%	1.21%	7.64%	0.86%	1.85%	0.35%
过去三个月	6.52%	1.55%	5.24%	1.14%	1.28%	0.41%
过去六个月	-12.30%	1.61%	-6.98%	1.16%	-5.32%	0.45%
过去一年	-19.21%	1.44%	-10.33%	1.00%	-8.88%	0.44%
过去三年	44.20%	1.51%	17.68%	1.01%	26.52%	0.50%
自基金合同生效起至今	981.13%	1.56%	309.81%	1.33%	671.32%	0.23%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

因为本基金属于混合型基金，一般情况下股票投资比例大约为 80%，因此本基金采用业界较为公认的、市场代表性较好的沪深 300 指数和中国债券总指数加权作为本基金的业绩评价基准。

### 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

银华价值优选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：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金股票投资比例浮动范围：60%–95%；除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为 5%–40%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。其中，

现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于股票资产的资金中，不低于 80% 的资产将投资于具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 174 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投资基金(LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、



银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开

放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华华智三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型

开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
倪明先生	本基金的基金经理	2011年9月26日	-	17年	博士学位。曾在大成基金管理有限公司从事研究分析工作，历任债券信用分析师、债券基金助理、行业研究员、股票基金助理等职，并曾于2008年1月12日至2011年4月15日期间担任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理职务。2011年4月加盟银华基金管理有限公司。自2011年9月26日起担任银华核心价值优选混合型证券投资基金基金经理，自2015年5月6日起兼任银华领先策略混合型证券投资基金基金经理，自2015年8月27日起兼任银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自2016年7月8日至2017年9月4日兼任银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，自2017年8月11日起兼任银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2017年11月3日至2020年9月8日兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自2017年11月24日至2022年4月8日兼任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2020年4月

					30日起兼任银华丰享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
苏静女士	本基金的基金经理	2017年10月30日	-	15.5年	硕士学位。曾就职于工银瑞信基金管理有限公司、宏源证券股份有限公司、诺安基金管理有限公司,先后从事农业、家电、食品饮料行业研究。2014年1月加入银华基金,历任行业研究员、投资经理,基金经理助理。自2017年8月11日起担任银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2017年10月30日起兼任银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理,自2017年11月24日至2022年4月8日兼任银华稳利灵活配置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、《银华核心价值优选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 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去两个季度不同时间窗内(1日内、3日内及5日内)同向交易的交易价差从T检验(置信度为95%)和溢价率占优频率等方面进行了专项分析,未发现违反公平交易制度的异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年 1 季度的资本市场在多重因素影响下，出现了较大幅度的下跌，上证指数跌幅-10.65%、深证成指跌幅-18.44%、创业板指数跌幅-19.96%，万得全 A 跌幅-13.92%；市场出现如此大幅的下跌，核心在于几个原因：

1、首先是经济走势出现了显著下行的态势，地产作为当前经济的重要支柱，销售、拿地等指标都出现了显著下滑，进而对经济形成了较大拖累；虽然在 4 季度的经济工作会议重新把稳增长放在了首位，但政策边际转向到形成实物工作量出现明显效果还需要时间；

2、其次，各地疫情出现了持续高发，上海、深圳等超一线城市的疫情严重，对于经济活动、消费和市场风险偏好都形成了较大的冲击；

3、最后，美联储的货币政策紧缩和缩表预期对整体市场的风险偏好和估值也形成了抑制作用，在这样的背景下，北上资金的持续撤出对于市场也形成了较大的压力。此外，俄乌冲突加剧了市场对于通胀和全球经济的担忧，市场进一步承压，甚至开始预期未来出现滞涨的局面；

回顾 22 年 2 季度的资本市场，4 月份出现了显著下跌，在 4 月底上证指数跌破 2900 点后，出现了连续 2 个月的大幅反弹，各板块都出现了明显上涨，成长股中基本面最好的电动车、光伏、风电以及受益于消费复苏的食品饮料、美容护理、社会服务等板块轮番上涨，市场情绪和风险偏好显著回升；

4 月份的下跌时延续反应 1 季度市场持续下跌的多重利空因素，首先是在上海、北京等地疫情严重的背景下，市场对于经济的持续下滑出现了更为悲观的预期；其次是对海外通胀的担忧引发了市场的持续调整；4 月底的反弹首先还是超跌反弹的性质，但之后市场担忧的多重因素都出现了逆转：首先是北京、上海疫情的成功控制使得市场风险偏好出现提升，其次是在疫情得到充分控制的背景下，政策的重心重新转向稳经济、促消费，相关的行业景气度出现了明显的回升；此外，美联储的持续加息也使得市场对于通胀和大宗商品的下行边际转向乐观预期。多重因素的影响，使得市场的反弹得以延续，并出现了成长、消费、顺周期板块轮番上涨的局面。

在 1 季度，我们依然保持了之前的仓位水平，因为我们始终认为仓位策略并不是长期能够取得稳定超额收益的核心策略；在行业配置方面，我们重点配置的行业及投资逻辑的情况如下：

##### 1、电力设备新能源：

1) 电动车：整体上我们降低了电动车板块的配置比例，并将结构集中在一线电池厂商上；首

先在市场整体处于低迷的背景下，电动车板块作为涨幅和持仓都居前的成长股板块，不可避免的面临回调压力；此外，从行业自身逻辑来看，锂价的持续上涨在通过整车价格持续上调转嫁，市场对于需求的承受能力出现了明显的担忧，成为压制板块的主要分歧；一线电池厂商具有最强的供应链管理能力和溢价能力，我们认为是抵御上述风险的最好标的。

2) 光伏：我们适度配置了光伏板块，但整体持仓比例不高；光伏面临的问题和电动车类似，除了市场风格问题之外，硅料价格的持续高位对于需求也有抑制作用，当前来看并没有看到硅料价格出现下行的迹象；

3) 风电及新能源运营商在我们的整体持仓中，比例相对较低。

## 2、大消费板块：

各地疫情的持续反复对于消费形成了拖累，此外经济的持续低迷也影响了整体消费水平的恢复；但向未来看，我们认为在政策力度不断加大的背景下，经济的恢复以及疫情的平复是大概率事件，而被压抑的消费需求也会出现较强的回补。

在大消费板块，我们的配置集中在食品饮料中的白酒、啤酒，同时我们也在左侧适度配置了社会服务业中的免税以及出行产业链中的高铁。

## 3、医药板块：

在医保控费、疫情管控对于医疗资源的分流等因素的影响下，整体医药的行业景气度受到了抑制，在医药板块中我们选择配置的方向是景气度好、业绩持续高增长的 CXO 行业龙头公司，同时受整体市场的影响，在持续下跌过程中，估值也出现了较大幅度的下降，因此性价比出现了显著提升；

## 4、农业板块：

1) 生猪养殖板块是今年为数不多的未来景气度确定性上升的板块，目前看猪价依然处于低位、能繁母猪去化率也在去化的初期，从头均市值的角度来看，股价的上行空间依然较大；

2) 转基因育种是类似于科技股属性的板块，今年会是转基因育种的元年，明年开始将继续加速渗透。

## 5、军工板块：

军工作为成长股板块的细分方向，今年以来受到市场风格的负面影响较大，因此年初至今跌幅居前；但考虑到军工板块的长期成长逻辑没有在下跌过程中被显著破坏，对于业绩能够持续兑现的细分行业龙头公司，我们继续保持看好。

在 2 季度，我们的投资情况如下：

在 2 季度，我们依然保持了之前的仓位水平，因为我们始终认为仓位策略并不是长期能够取

得稳定超额收益的核心策略；在行业配置方面，我们重点配置的行业及投资逻辑的情况如下：

### 1、大消费板块

大消费板块是我们在 2 季度增持比例最高的板块，原因在于随着疫情的缓解，经济和消费的复苏都是确定性向上。此外，经过 3-4 月份的调整，整个大消费板块的估值、股价位置和市场预期都处于相对低位。因此，大消费板块是我们重点看好的方向。具体来说：

1) 食品饮料：我们增持的主要集中在高端白酒、啤酒两个细分方向；

2) 家居：我们相信随着地产政策的持续加码，地产行业的边际改善是大概率事件，因此行业的贝塔叠加重点公司市占率持续提升的阿尔法因素是我们看好这个细分方向的主要原因；

3) 家电：家电同样受益于地产行业的复苏，且伴随着大宗商品价格的回落，利润率有望提升；

4) 社会服务：在疫情得到有效控制后，出行行业面临着景气度的提升，在细分行业中我们看好并重点增持了免税行业的龙头公司。未来的疫情防控大概率会是外紧内松，因此国内消费的复苏会是比较确定的。

### 2、顺周期行业

顺周期行业也是我们在 2 季度重点增持并看好的方向，核心原因在于基建和地产都会在下半年发力，成为顺周期行业景气度上行的重要支持因素。基建在上半年的资金准备比较充分，但受制于疫情防控因素并没有有效形成实物工作量，伴随着下半年的政策重心转向稳经济，预计无论是资金支持力度还是实物工作量都会相比上半年得到有效提升，此外地产的支持政策也会在下半年形成成效。在顺周期板块中，我们重点看好两个方向：

1) 工程机械：下半年基建和地产的发力有望使得工程机械行业出现边际景气度的显著上行，且工程机械是从 21 年 2 季度就开始回落，因此在未来 4 个季度都面临低基数，其中的龙头公司自身的电动化和出口高增长又会带来额外的阿尔法成长性；

2) 建材：消费建材直接受益于地产和基建的复苏，且龙头公司市占率持续提升；此外水泥、石膏板等行业的龙头公司也会处于景气度环比上行的趋势中，且估值和股价位置都在相对低位。

### 3、成长性行业

1) 电新：在 2 季度反弹力度最大的是电新，电动车（汽车）、光伏、风电板块涨幅巨大，电新板块相对市场我们是低配的，且在上涨过程中较早减持，造成了超额收益情况不理想。站在这个时点，我们认为板块的当期景气度依然很好（7、8 月份的电动车销量高增长、光伏景气度和风电的招标情况都很好），但展望中期隐忧已经在出现：首先是电动车，今年在稳增长背景下补贴进一步加码，因此当期电动车销量很好，但 23 年面临的需求提前透支、补贴下降以及碳酸锂价格进一步上涨带来的成本压力，会使得市场对 23 年的行业景气度产生担忧；光伏面临一样的硅料成本

过高带来的压力；风电的招标量很好，但业绩的释放需要等到 23 年才能看到，需要面临 2-3 个季度的业绩低速增长期。此外，股价位置、估值水平以及机构配置比例都达到了很高的位置。因此综合考虑，我们不会在这个板块继续加大配置力度，既然在上涨过程中没有充分享受到超额收益，那么在相对顶部位置不能再犯第二次错误。

2) 军工：军工是我们相对最看好的成长性板块，军工在 4 月底的反弹中是率先反弹的，但之后的涨幅是显著落后于电新的。军工行业的景气度和业绩增速都维持在很好的水平，且估值和业绩增速的匹配度更加合理，因此我们会考虑持续增加军工板块的配置比例；

除此以外，我们在成长股板块中还重点关注电子、传媒和计算机的潜在投资机会，这三个板块在这轮反弹中都是显著落后的，自身的成长逻辑确实较弱，但目前积极的因素也在孕育之中，因此我们会增加对上述三个板块的关注和持续跟踪。

#### 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 2.8104 元；本报告期基金份额净值增长率为-12.30%，业绩比较基准收益率为-6.98%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年的资本市场，我们保持谨慎乐观的态度，不利因素在于市场经历了 2 季度的大幅反弹，股价位置和估值以及风险偏好都在相对高位；有利因素在于稳经济政策的持续发力也会在下半年开始产生实质性的效果。

因此我们会沿着稳增长的主线不断优化组合结构，保持整体组合的波动性和较好的均衡性，同时，我们也将始终如一的以勤勉尽责的工作态度不断提升自己的专业能力与业务能力，完善优化自己的方法论体系、努力通过深度研究的方式拓展自己的能力圈，为持有人持续创造超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华核心价值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	323,371,040.74	256,821,109.73
结算备付金		4,795,682.92	6,166,594.34
存出保证金		1,074,520.51	1,242,980.44

交易性金融资产	6.4.7.2	2,913,817,155.40	3,375,747,925.10
其中：股票投资		2,913,817,155.40	3,375,747,925.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		224,246.32	161,063.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	38,457.93
资产总计		3,243,282,645.89	3,640,178,130.67
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		79,576,624.67	-
应付赎回款		3,123,911.99	2,712,439.06
应付管理人报酬		3,670,600.68	4,715,869.60
应付托管费		611,766.79	785,978.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,741,010.71	5,042,793.84
负债合计		90,723,914.84	13,257,080.75
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	347,010,707.69	350,100,689.27
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,805,548,023.36	3,276,820,360.65
净资产合计		3,152,558,731.05	3,626,921,049.92

负债和净资产总计		3,243,282,645.89	3,640,178,130.67
----------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.8104 元，基金份额总额 1,121,755,303.49 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华核心价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-419,646,653.37	80,997,391.01
1. 利息收入		583,758.48	795,441.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	583,758.48	782,443.75
债券利息收入		-	2,292.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	10,705.42
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-389,535,058.23	312,177,190.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-409,123,279.89	295,638,309.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	8,158,240.32
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	19,588,221.66	8,380,641.39
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-30,715,722.11	-232,119,378.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	20,368.49	144,137.38
<b>减：二、营业总支出</b>		26,631,689.62	47,971,267.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,715,064.54	31,323,440.21

2. 托管费	6.4.10.2.2	3,785,844.10	5,220,573.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	8.18
8. 其他费用	6.4.7.23	130,780.98	11,427,245.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-446,278,342.99	33,026,123.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-446,278,342.99	33,026,123.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-446,278,342.99	33,026,123.91

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华核心价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	350,100,689.27	-	3,276,820,360.65	3,626,921,049.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	350,100,689.27	-	3,276,820,360.65	3,626,921,049.92
三、本期增减变动额（减）	-3,089,981.58	-	-471,272,337.29	-474,362,318.87

少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-446,278,342.99	-446,278,342.99
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,089,981.58	-	-24,993,994.30	-28,083,975.88
其中:1.基金申购款	8,275,116.28	-	64,328,273.74	72,603,390.02
2.基金赎回款	-11,365,097.86	-	-89,322,268.04	-100,687,365.90
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	347,010,707.69	-	2,805,548,023.36	3,152,558,731.05
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	419,106,033.20	-	4,263,529,319.24	4,682,635,352.44
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	419,106,033.20	-	4,263,529,319.24	4,682,635,352.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-47,997,465.75	-	-461,556,930.26	-509,554,396.01
(一)、综合收益总额	-	-	33,026,123.91	33,026,123.91
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-47,997,465.75	-	-494,583,054.17	-542,580,519.92
其中:1.基金申购款	13,331,124.24	-	131,514,213.95	144,845,338.19
2.基金赎回款	-61,328,589.99	-	-626,097,268.12	-687,425,858.11
(三)、本期向基金份额	-	-	-	-

额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	371,108,567.45	-	3,801,972,388.98	4,173,080,956.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华核心价值优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]117 号文《关于同意银华核心价值优选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于 2005 年 8 月 1 日至 2005 年 9 月 16 日向社会公开发发行募集，基金合同于 2005 年 9 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 519,070,123.63 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定，经协商基金托管人同意，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起，本基金名称由“银华核心价值优选股票型证券投资基金”更名为“银华核心价值优选混合型证券投资基金”。本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合的基本范围：股票资产（A 股、存托凭证以及监管机构授权

的其他市场的股票资产等)、债券资产(国债、金融债、企业债、可转债等债券资产)、货币市场工具(含央行票据、债券回购等)以及现金资产;本基金还可以投资法律、法规允许的其它金融工具。各类资产投资比例须符合《基金法》的规定。本基金的具体投资比例如下:股票投资比例浮动范围:60%-95%;除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为5%-40%,其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于5%。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于股票资产的资金中,不低于80%的资产将投资于具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司。本基金投资的业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2022年06月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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



## (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即

可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

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

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

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、

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

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

#### 新金融工具准则

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

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

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

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

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

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 256,821,109.73

元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 34,788.25 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 256,855,897.98 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,166,594.34 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,052.50 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,169,646.84 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,242,980.44 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 615.34 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,243,595.78 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 161,063.13 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1.84 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 161,064.97 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 38,457.93 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 34,788.25 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 3,052.50 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 615.34 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 1.84 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

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

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

### 6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利

息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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

#### 6.4.6.3 企业所得税

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

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

#### 6.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	323,371,040.74
等于：本金	323,337,990.58
加：应计利息	33,050.16
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	323,371,040.74

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,741,211,119.51	-	2,913,817,155.40	172,606,035.89
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	2,741,211,119.51	-	2,913,817,155.40	172,606,035.89

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 6.4.7.5 债权投资

注：无。

**6.4.7.6 其他债权投资**

注：无。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

注：无。

**6.4.7.8 其他资产**

注：无。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	846.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,844,064.01
其中：交易所市场	2,844,064.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	216,575.64
其他	679,524.73
合计	3,741,010.71

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,131,744,049.30	350,100,689.27
本期申购	26,750,362.23	8,275,116.28
本期赎回（以“-”号填列）	-36,739,108.04	-11,365,097.86
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	1,121,755,303.49	347,010,707.69

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

**6.4.7.11 其他综合收益**

注：无。

**6.4.7.12 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------



本期期初	3,630,061,957.38	-353,241,596.73	3,276,820,360.65
本期利润	-415,562,620.88	-30,715,722.11	-446,278,342.99
本期基金份额交易产生的变动数	-29,912,613.52	4,918,619.22	-24,993,994.30
其中：基金申购款	80,159,856.48	-15,831,582.74	64,328,273.74
基金赎回款	-110,072,470.00	20,750,201.96	-89,322,268.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,184,586,722.98	-379,038,699.62	2,805,548,023.36

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	523,327.25
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	49,799.47
其他	10,631.76
合计	583,758.48

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-409,123,279.89
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	-409,123,279.89

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	3,729,862,420.50
减：卖出股票成本总额	4,128,322,825.17
减：交易费用	10,662,875.22
买卖股票差价收入	-409,123,279.89

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

**6.4.7.15 债券投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

注：无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	19,588,221.66
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	19,588,221.66

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-30,715,722.11
股票投资	-30,715,722.11
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	-30,715,722.11

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	20,368.49

合计	20,368.49
----	-----------

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	52,068.27
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	605.34
账户维护费	18,600.00
合计	130,780.98

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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(%)
东北证券	188,015,440.13	2.53	-	-
西南证券	2,560,124,014.53	34.48	79,166,261.26	1.04

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30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 (%)
东北证券	175,097.89	2.78	-	-
西南证券	2,384,222.09	37.91	1,196,433.93	42.07
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	73,727.49	1.13	73,727.49	2.88
第一创业	743,941.49	11.45	-	-

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	22,715,064.54
其中：支付销售机构的客户维护费	3,979,929.86	5,271,634.17

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计

提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,785,844.10	5,220,573.34

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

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	323,371,040.74	523,327.25	456,650,487.66	723,721.13

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	锁定期送股/转股
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过

风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未

发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	323,371,040.74	-	-	-	323,371,040.74
结算备付金	4,795,682.92	-	-	-	4,795,682.92
存出保证金	1,074,520.51	-	-	-	1,074,520.51
交易性金融资产	-	-	-2,913,817,155.40	-	2,913,817,155.40
应收申购款	-	-	-	224,246.32	224,246.32
资产总计	329,241,244.17	-	-2,914,041,401.72	-	3,243,282,645.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,123,911.99	3,123,911.99
应付管理人报酬	-	-	-	3,670,600.68	3,670,600.68
应付托管费	-	-	-	611,766.79	611,766.79
应付清算款	-	-	-	79,576,624.67	79,576,624.67
其他负债	-	-	-	3,741,010.71	3,741,010.71
负债总计	-	-	-	90,723,914.84	90,723,914.84
利率敏感度缺口	329,241,244.17	-	-2,823,317,486.88	-	3,152,558,731.05
上年度末 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	256,821,109.73	-	-	-	256,821,109.73
结算备付金	6,166,594.34	-	-	-	6,166,594.34
存出保证金	1,242,980.44	-	-	-	1,242,980.44
交易性金融资产	-	-	-3,375,747,925.10	-	3,375,747,925.10
应收利息	-	-	-	38,457.93	38,457.93
应收申购款	1,183.72	-	-	159,879.41	161,063.13
资产总计	264,231,868.23	-	-3,375,946,262.44	-	3,640,178,130.67



负债					
应付赎回款	-	-	-	2,712,439.06	2,712,439.06
应付管理人报酬	-	-	-	4,715,869.60	4,715,869.60
应付托管费	-	-	-	785,978.25	785,978.25
应付交易费用	-	-	-	4,137,411.62	4,137,411.62
其他负债	-	-	-	905,382.22	905,382.22
负债总计	-	-	-	13,257,080.75	13,257,080.75
利率敏感度缺口	264,231,868.23	-	-	-3,362,689,181.69	3,626,921,049.92

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,913,817,155.40	92.43	3,375,747,925.10	93.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,913,817,155.40	92.43	3,375,747,925.10	93.07

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	192,541,466.13	247,815,325.72
	业绩比较基准下降 5%	-192,541,466.13	-247,815,325.72

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	2,913,738,462.31	3,375,078,666.66
第二层次	-	5,504.49

第三层次	78,693.09	663,753.95
合计	2,913,817,155.40	3,375,747,925.10

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,913,817,155.40	89.84
	其中：股票	2,913,817,155.40	89.84
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	328,166,723.66	10.12
8	其他各项资产	1,298,766.83	0.04
9	合计	3,243,282,645.89	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	33,940,560.58	1.08
B	采矿业	30,644,047.00	0.97
C	制造业	2,255,178,687.56	71.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,345,240.04	0.84
E	建筑业	36,909,679.54	1.17
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	216,958,362.24	6.88
J	金融业	32,664,882.60	1.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	175,886,548.77	5.58
M	科学研究和技术服务业	105,289,147.07	3.34
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,913,817,155.40	92.43

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	132,920	271,821,400.00	8.62
2	300750	宁德时代	348,431	186,062,154.00	5.90
3	600809	山西汾酒	480,456	156,052,108.80	4.95
4	600031	三一重工	7,941,823	151,371,146.38	4.80
5	601888	中国中免	565,249	131,663,449.57	4.18
6	002271	东方雨虹	2,498,750	128,610,662.50	4.08
7	688111	金山办公	585,212	115,356,989.44	3.66
8	603259	药明康德	1,012,493	105,289,147.07	3.34

9	600600	青岛啤酒	927,244	96,359,196.48	3.06
10	002049	紫光国微	448,361	85,063,048.92	2.70
11	002572	索菲亚	2,606,701	71,684,277.50	2.27
12	300775	三角防务	1,480,351	71,278,900.65	2.26
13	000786	北新建材	1,869,500	64,722,090.00	2.05
14	688008	澜起科技	1,046,964	63,425,079.12	2.01
15	600862	中航高科	2,250,000	63,225,000.00	2.01
16	603444	吉比特	161,100	62,506,800.00	1.98
17	002415	海康威视	1,552,000	56,182,400.00	1.78
18	000858	五粮液	260,900	52,683,537.00	1.67
19	600887	伊利股份	1,228,400	47,846,180.00	1.52
20	603899	晨光股份	833,804	46,759,728.32	1.48
21	002371	北方华创	168,688	46,746,818.56	1.48
22	002385	大北农	5,983,523	46,731,314.63	1.48
23	002027	分众传媒	6,571,040	44,223,099.20	1.40
24	603613	国联股份	441,248	39,094,572.80	1.24
25	300850	新强联	429,685	38,254,855.55	1.21
26	000059	华锦股份	6,374,500	37,737,040.00	1.20
27	600132	重庆啤酒	249,914	36,637,392.40	1.16
28	600882	妙可蓝多	768,764	35,978,155.20	1.14
29	300957	贝泰妮	160,500	34,913,565.00	1.11
30	600963	岳阳林纸	5,777,966	34,841,134.98	1.11
31	300498	温氏股份	1,594,202	33,940,560.58	1.08
32	300059	东方财富	1,286,019	32,664,882.60	1.04
33	300896	爱美客	54,302	32,581,743.02	1.03
34	000959	首钢股份	6,677,500	31,784,900.00	1.01
35	603501	韦尔股份	182,988	31,662,413.64	1.00
36	600197	伊力特	1,034,983	31,152,988.30	0.99
37	000762	西藏矿业	547,900	30,644,047.00	0.97
38	000651	格力电器	902,500	30,432,300.00	0.97
39	688363	华熙生物	209,015	29,717,752.70	0.94
40	000333	美的集团	483,600	29,204,604.00	0.93
41	000423	东阿阿胶	784,301	28,979,921.95	0.92
42	002850	科达利	181,342	28,833,378.00	0.91
43	600585	海螺水泥	803,900	28,361,592.00	0.90
44	601985	中国核电	3,840,414	26,345,240.04	0.84
45	601668	中国建筑	4,709,200	25,052,944.00	0.79
46	000568	泸州老窖	67,000	16,518,180.00	0.52
47	601868	中国能建	5,002,842	11,856,735.54	0.38
48	300813	泰林生物	254,565	10,358,249.85	0.33
49	688295	中复神鹰	13,998	524,785.02	0.02
50	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00

51	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
52	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	002371	北方华创	192,646,947.76	5.31
2	688111	金山办公	180,582,482.59	4.98
3	000858	五粮液	156,055,537.08	4.30
4	601888	中国中免	153,531,572.12	4.23
5	002271	东方雨虹	131,216,470.28	3.62
6	603501	韦尔股份	125,922,102.73	3.47
7	002714	牧原股份	118,974,302.01	3.28
8	601012	隆基绿能	116,306,640.12	3.21
9	600862	中航高科	109,455,364.83	3.02
10	600600	青岛啤酒	103,952,119.20	2.87
11	600031	三一重工	97,505,282.16	2.69
12	688008	澜起科技	84,735,942.26	2.34
13	002385	大北农	84,003,685.13	2.32
14	300498	温氏股份	83,361,557.04	2.30
15	601816	京沪高铁	74,226,552.00	2.05
16	601658	邮储银行	68,896,581.85	1.90
17	300750	宁德时代	68,642,311.88	1.89
18	002241	歌尔股份	63,488,003.16	1.75
19	002709	天赐材料	63,485,594.62	1.75
20	600011	华能国际	60,503,363.09	1.67

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。

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

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	000858	五粮液	157,299,466.07	4.34
2	002371	北方华创	152,290,244.22	4.20
3	601012	隆基绿能	141,843,325.99	3.91
4	002410	广联达	126,367,669.61	3.48
5	002714	牧原股份	108,593,765.65	2.99
6	002241	歌尔股份	106,349,553.56	2.93
7	002027	分众传媒	103,220,137.54	2.85
8	600703	三安光电	99,312,794.45	2.74
9	000807	云铝股份	97,384,791.42	2.69
10	002304	洋河股份	91,434,418.31	2.52

11	300347	泰格医药	88,972,493.66	2.45
12	000998	隆平高科	88,387,814.24	2.44
13	603799	华友钴业	84,091,172.17	2.32
14	601877	正泰电器	82,232,392.33	2.27
15	300059	东方财富	81,306,876.09	2.24
16	603259	药明康德	81,191,951.19	2.24
17	603501	韦尔股份	77,660,472.06	2.14
18	002812	恩捷股份	75,040,178.50	2.07
19	600887	伊利股份	72,120,520.80	1.99
20	601816	京沪高铁	71,578,525.57	1.97

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。

#### 7.4.3 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	3,697,107,777.58
卖出股票收入（成交）总额	3,729,862,420.50

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。

#### 7.5 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。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	1,074,520.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	224,246.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,298,766.83

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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 (%)
111,257	10,082.56	3,195,447.96	0.28	1,118,559,855.53	99.72



**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	59,381.33	0.01

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2005年9月27日） 基金份额总额	519,070,123.63
本报告期期初基金份额总额	1,131,744,049.30
本报告期基金总申购份额	26,750,362.23
减：本报告期基金总赎回份额	36,739,108.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,121,755,303.49

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

**§ 10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动****10.2.1 基金管理人的重大人事变动**

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

**10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未变更为其审计的会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
西南证券	4	2,560,124,014.53	34.48	2,384,222.09	37.91	-
方正证券	4	1,907,523,946.28	25.69	1,410,880.67	22.43	-
东吴证券	2	866,177,565.07	11.67	633,424.35	10.07	-
银河证券	1	359,629,170.29	4.84	334,934.09	5.33	-
上海证券	1	337,487,381.77	4.55	314,294.38	5	-
华安证券	1	328,570,759.08	4.43	305,992.31	4.87	-
太平洋证券	4	266,896,918.34	3.6	195,181.56	3.1	-
长城证券	2	193,748,460.05	2.61	180,439.44	2.87	-
东北证券	5	188,015,440.13	2.53	175,097.89	2.78	-
海通证券	2	161,411,779.40	2.17	118,040.57	1.88	-
民生证券	2	95,154,652.54	1.28	88,617.56	1.41	-

招商证券	2	56,539,025.54	0.76	52,654.67	0.84	-
华福证券	1	56,039,117.36	0.75	52,186.74	0.83	-
华宝证券	3	46,616,329.24	0.63	43,413.05	0.69	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海华信	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
西部证券	3	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信华南	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

注：a)、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。

b)、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
西南证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海华信	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、权证交易等除股票交易外的其他证券投资交易。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海万得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, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2022 年 01 月 19 日
2	《银华核心价值优选混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2022 年 01 月 21 日

		网站	
3	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 01 月 21 日
4	《银华核心价值优选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	2022 年 01 月 28 日
5	《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 01 月 28 日
6	《银华核心价值优选混合型证券投资基金招募说明书更新(2022 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 28 日
7	《银华核心价值优选混合型证券投资基金 2021 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 29 日
8	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 03 月 29 日
9	《银华基金管理股份有限公司关于终止国开证券股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2022 年 04 月 01 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 04 月 19 日
11	《银华核心价值优选混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 20 日
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 04 月 20 日
13	《银华核心价值优选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	2022 年 05 月 06 日
14	《银华核心价值优选混合型证券投资基金招募说明书更新(2022 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 06 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 06 月 14 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2022 年 1 月 28 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》，本基金自 2022 年 1 月 28 日起可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华核心价值优选股票型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华核心价值优选混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华核心价值优选混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华核心价值优选混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2022 年 8 月 29 日