

银华富利精选混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表	20
6.2 利润表	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	22

6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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的情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华富利精选混合型证券投资基金
基金简称	银华富利精选混合
基金主代码	009542
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 13 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	4,212,897,399.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，精选符合中国经济发展方向、具备利润创造能力、并且估值水平具备竞争力的优势上市公司，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对经济基本面、宏观政策、市场情绪、行业周期等因素进行定量与定性相结合的分析研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。 本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
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）*20%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。 本基金将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或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

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 号东方广场东方经贸城 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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	701,079,520.31
本期利润	821,731,636.25
加权平均基金份额本期利润	0.1464
本期加权平均净值利润率	12.84%
本期基金份额净值增长率	12.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	451,821,617.58
期末可供分配基金份额利润	0.1072
期末基金资产净值	5,379,097,806.93
期末基金份额净值	1.2768
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	27.68%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.22%	1.47%	-0.72%	0.56%	5.94%	0.91%
过去三个月	24.97%	1.56%	2.94%	0.65%	22.03%	0.91%
过去六个月	12.65%	2.11%	2.32%	0.89%	10.33%	1.22%
自基金合同 生效起至今	27.68%	1.68%	7.81%	0.84%	19.87%	0.84%

注：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）*20%+中债综合指数收益率*20%

中证 800 指数是由中证 500 指数和沪深 300 指数的成份股一起构成，其综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同

时公信力较好的股票指数，适合作为本基金内地股票投资部分的业绩比较基准。

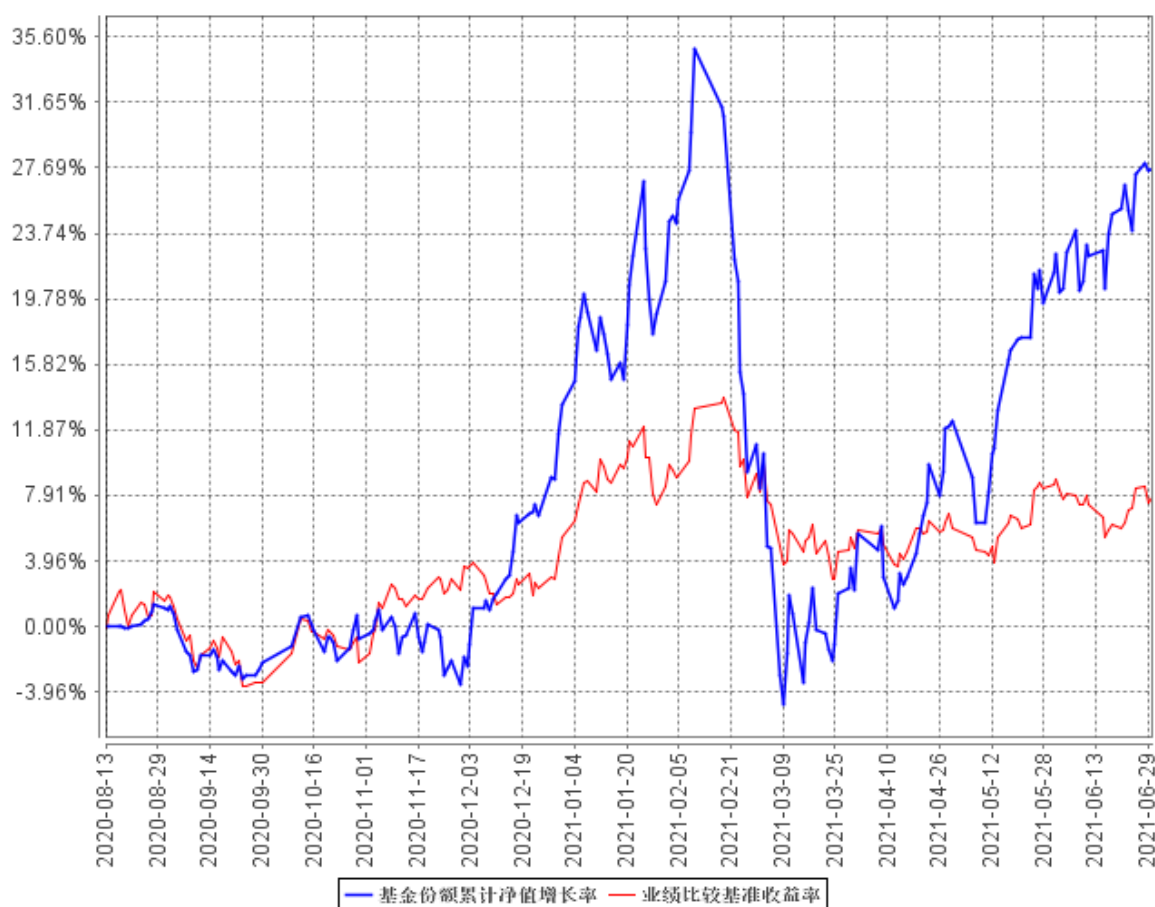
恒生指数是香港股市价格的重要指标，指数由若干只成份股（即蓝筹股）市值计算出来，代表了香港交易所所有上市公司 70%的市值，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，选样科学客观，行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，是目前市场上较有影响力的港股投资业绩比较基准，适合作为本基金港股投资部分的业绩比较基准。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，能够综合反映债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一；该指数样本覆盖广泛，编制方法合理，样本券包括记账式国债、央行票据、短期融资券、中期票据、政策性银行债券、商业银行债券、证券公司短期融资券、证券公司债、地方企业债、国际机构债券、非银行金融机构债、中央企业债等债券。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现；指数公布透明、公开，具有较好的市场接受度。

本基金是混合型基金，基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的 50%；其余资产投资于债券及其它具有高流动性的短期金融工具。总之，基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够较好的反映本基金的风险收益特征。

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

基金份额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 2020 年 08 月 13 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：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

§ 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 6 月 30 日，本基金管理人管理着 149 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、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、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、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、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、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、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、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈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、银华长江经济带主题债券型证券投资基金、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、银华中证 800 汽车与零部件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。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		
焦巍先生	本基金的基金经理	2020 年 8 月 13 日	-	21.5 年	博士学位。曾就职于中国银行海南分行、湘财荷银基金管理有限公司、平安

					大华基金管理有限公司、大成基金管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司、平安信托有限责任公司，于 2018 年 10 月加入银华基金，现任投资管理一部基金经理。自 2018 年 11 月 26 日至 2019 年 12 月 13 日担任银华泰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 12 月 27 日起兼任银华富裕主题混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 26 日起兼任银华国企改革混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 8 月 13 日起兼任银华富利精选混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 28 日起兼任银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有证券从业资格。国籍：中国。
秦锋先生	本基金的基金经理	2020 年 8 月 13 日	-	12.5 年	硕士学位。曾就职于航天科技财务有限责任公司，2011 年 2 月加入银华基金管理有限公司，曾任助理行业研究员、行业研究员、基金经理助理，现任基金经理。自 2017 年 9 月 28 日起担任银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 2 月 13 日至 2021 年 5 月 12 日兼任银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 8 月 13 日起兼任银华富利精选混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格，国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效之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、《银华富利精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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

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 1 次，原因是量化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

本基金上半年主要调出和调入操作以及伴随的反思如下：

1、对原来重仓的快递业龙头进行了清仓。我们原来重仓这个行业龙头的原因是基于其日常生活的粘性以及用户愿意为时间付费从而加强其行业护城河壁垒的判断。事实证明我们的误判很可能只是基于疫情期间的特殊情况。护城河分为几种，其中一种护城河从目前的情况看来，需要永远的不停加深加阔，城里的人民需要为城主的伟大理想不停奉献而非籍着墙高水深过上幸福的生活。同时基于古代战争的护城河还总是面临现代空军的越位打击。在基金管理人重读了段永平的投资心得之后，发现其早就对需要雇佣过多人力数目的行业投资提出过警示。同时在一季报之后，我们发现自己对需要基于信息优势的投资标的处于先天劣势，因此本着亡羊补牢的态度予以了认错回避。

2、对港股配置做了重新的梳理。一方面我们减持了港股的消费品龙头，我们投资该公司的時候看重的是上游资源的垄断，和产品定价权，期待的是通过新产品推出提供报表的增量，通过去年疫情的检验，在传统业务方面护城河很深，但是涉及到新品增长，以及长期的销量增速等问题，该公司的业绩成长性可能比我们预期的要低一些。第二是我们减持了港股的互联网巨头的配置比例。除了突然发生的反垄断等政策风险，这几年在本来一家独大的互联网模式中，接二连三出现了新的互联网大公司，因为大家的商业模式都是扩展流量之后，通过广告、游戏、电商等方式实现变现，因此多少都会对现有的互联网龙头形成边际上的影响，也就会体现在估值折价层面。相比来看，我们尝试着在港股医药板块选择可能业绩增速更快，成长空间更确定的投资品种去做管理优化，从而提升组合的业绩弹性。

3、对白酒的香型进行了再整理。基于很可能事后会被证明为瞎子摸象的调研和主观臆测的判断，本管理人调出了依然优秀的浓香龙头，把仓位主要集中在酱香、清香和馥郁香的配置上。口味的变迁是长期和偏主观的过程，但我们只是主观的倾向了酱香和含酱高的品种的配重。上半年的大酒普遍走势落后于小酒，这一方面有资金博弈的原因，但另一方面不能排除背后有口味变迁和产业内卷的原因。消费品投资从来不是被动的就地躺赢，而是需要不断试错、纠正、再瞄准的俯卧撑运动。

4、增加了对医美行业特别是敏感肌龙头和注射类产品龙头的配置。我们从来都尊重新兴行业的情怀，但同时怀着威尼斯人的生意之心来使用持有人的一分一厘。男人的胃和女人的脸始终是能够产生品牌溢价和消费者定价权偏移的行业。对市场上充斥的酱香科技，医美强国之类的指责，本着君子和而不同的态度，本管理人认为投资各个产业的同道勿须相轻相煎。

5、调整了医药板块内部的投资结构，特别是传统中药、疫苗核心品种和医疗服务的权重，减少了创新药相关标的。我们认为，商业模式投资方法论很多。但一家企业的最终市场份额、定价权，最终取决于这个行业或者产品本身的特质有关。比如医疗服务的地区属性，功能和品牌共振就会造就细分市场的龙头独一属性，以及研究型公司在单品种路线上超越所有对手会带来的短期爆发和长期领跑的可能。一言蔽之，就是没有对手的投资是最好的品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2768 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.65%，同期业绩比较基准收益率为 2.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对二季度和上半年的感慨回顾以及下半年的继续茫然：

1、从一季度到二季度，本基金重仓的一批公司被冠以了核心资产的概念，并经历了向下的大幅波动和迄今为止仍然分化的反弹。市场对这批公司的态度，使本基金管理不禁想起拿破仑从厄尔巴岛逃出后七天内一家报纸的题目变换——“第一天，科西嘉怪物在儒安港登陆；第二天，吃人魔鬼香格拉斯前进；第三天，篡位者进入格勒诺布尔；第四天，波拿巴占领里昂；第五天，拿破仑接近枫丹白露宫；第六天，皇帝抵达巴黎”。两个季度内，我们大多数投资的对象并没有发生实质的改变，只是市场的认知和投资人的主观心态调整更多。

2、其实对于管理人来说，上涨比下跌更难应付。下跌可以死扛，同时利用下跌检验自己组合的反脆弱能力和审视弱点所在。但上涨时会面临组合相对涨不动的抉择，或者涨多了存在所谓性价比品种的诱惑。大部分人的本能是兑现利润，卖出高估值公司，买入相对便宜品种或者降仓位。相应的，流传甚广的俗语是会买的是徒弟，会卖的是师傅。看错需要卖，估值过高需要卖，有相对收益和更好的强势品种需要卖等等。但在我们的体系中，所谓多高算高，多好算更好，都没有能力对此做出量化的定论。本基金管理人认为，投资的本质就是从生意角度进行比较的过程。包括了资产配置比较、行业比较、公司比较等等。通过比较筛选出来的优秀公司，尽管估值高涨幅大也不应卖出的原因在于，卓越公司往往会更卓越，犯不着因为卓越的价格高低而追随平庸。拉长维度看，估值很可能只是结果而不是原因。那么，是不是再好的公司也有涨幅顶和估值顶呢？我们坦承目前还不知道答案。管理人更倾向于认为，相对于平庸的人类和公司，优质公司的生命是可以无限延伸的。总有极少数公司可以穿越时空，创造价值，长成可持续的参天大树。在其面前，当下的估值只是矮小的小草。

3、本基金管理人更多的迷惑来自于希望拓展自身能力圈时候的迭代错乱：比如当习惯用商业模式和终局思维去看公司竞争格局时，会错过很多高增长低壁垒行业的投资机会。用同样的模式

思维，可以在芯片设计领域找到投资对象，但对新能源领域的机会全部失之交臂。但是，相对于这种投资方法之所失，对大多数平庸机会的拒绝更为重要。我们始终认为，只有拒绝平庸，才是接近正确公司的手段。本着对持有人的信托责任所在，我们将继续殚精竭虑，在追求卓越公司的道路上继续五月渡泸，深入不毛。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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遵规守信、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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华富利精选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	572,318,135.69	620,647,161.35
结算备付金		11,063,976.31	10,027,569.39
存出保证金		2,187,276.18	1,496,036.69
交易性金融资产	6.4.7.2	4,847,676,271.90	8,997,032,315.26
其中：股票投资		4,832,882,271.90	8,997,032,315.26
基金投资		-	-
债券投资		14,794,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		72,486,881.02	163,536,702.12
应收利息	6.4.7.5	361,436.63	78,798.60
应收股利		-	-
应收申购款		8,065,605.83	10,664,535.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,514,159,583.56	9,803,483,119.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		14,496,066.60	332.66
应付赎回款		109,295,822.55	233,958,062.74
应付管理人报酬		6,852,585.21	12,300,442.10
应付托管费		1,142,097.56	2,050,073.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,777,026.18	5,964,604.70
应交税费		-	0.30

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	498,178.53	715,751.42
负债合计		135,061,776.63	254,989,267.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,212,897,399.49	8,424,488,506.60
未分配利润	6.4.7.10	1,166,200,407.44	1,124,005,344.85
所有者权益合计		5,379,097,806.93	9,548,493,851.45
负债和所有者权益总计		5,514,159,583.56	9,803,483,119.02

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2768 元，基金份额总额 4,212,897,399.49 份。

6.2 利润表

会计主体：银华富利精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		892,638,199.82
1.利息收入		1,078,800.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	953,619.97
债券利息收入		125,180.49
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		757,261,754.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	748,187,968.36
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	9,073,785.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	120,652,115.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,645,529.31
减：二、费用		70,906,563.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	48,179,028.74

2. 托管费	6.4.10.2.2	8,029,838.23
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,486,359.77
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	6.4.7.20	211,336.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		821,731,636.25
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		821,731,636.25

注：本基金合同生效日为 2020 年 8 月 13 日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华富利精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	8,424,488,506.60	1,124,005,344.85	9,548,493,851.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	821,731,636.25	821,731,636.25
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）	-4,211,591,107.11	-779,536,573.66	-4,991,127,680.77
其中：1.基金申购款	1,080,005,717.58	189,797,169.20	1,269,802,886.78
2.基金赎回款	-5,291,596,824.69	-969,333,742.86	-6,260,930,567.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,212,897,399.49	1,166,200,407.44	5,379,097,806.93

注：本基金合同生效日为 2020 年 8 月 13 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华富利精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]744号《关于准予银华富利精选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《银华富利精选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立共募集人民币 9,885,942,504.25 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0716 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华富利精选混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,885,942,504.25 份基金份额,募集期间未产生利息折份额。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《银华富利精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括主板股票、中小板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、现金、股指期货等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%(投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%)。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率*60%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*20%+中债综合指数收益率*20%。

6.4.2 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》、《银华富利精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	572,318,135.69
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：	572,318,135.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,321,036,789.65	4,832,882,271.90	1,511,845,482.25
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	14,782,677.50	14,794,000.00
	银行间市场	—	—
	合计	14,782,677.50	14,794,000.00
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	3,335,819,467.15	4,847,676,271.90	1,511,856,804.75

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	53,101.43
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	2,623.31
应收债券利息	304,999.59
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	712.30
合计	361,436.63

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,777,026.18
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,777,026.18

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	374,206.20
应付证券出借违约金	-
预提费用	123,972.33
合计	498,178.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,424,488,506.60	8,424,488,506.60

本期申购	1,080,005,717.58	1,080,005,717.58
本期赎回(以“-”号填列)	-5,291,596,824.69	-5,291,596,824.69
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,212,897,399.49	4,212,897,399.49

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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-156,290,049.83	1,280,295,394.68	1,124,005,344.85
本期利润	701,079,520.31	120,652,115.94	821,731,636.25
本期基金份额交易产生的变动数	-92,967,852.90	-686,568,720.76	-779,536,573.66
其中：基金申购款	33,863,466.50	155,933,702.70	189,797,169.20
基金赎回款	-126,831,319.40	-842,502,423.46	-969,333,742.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	451,821,617.58	714,378,789.86	1,166,200,407.44

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	772,994.75
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	146,476.69
其他	34,148.53
合计	953,619.97

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	748,187,968.36

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	748,187,968.36

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,807,866,291.56
减：卖出股票成本总额	6,059,678,323.20
买卖股票差价收入	748,187,968.36

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,073,785.75
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	9,073,785.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	120,652,115.94
——股票投资	120,640,793.44
——债券投资	11,322.50
——资产支持证券投资	—
——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	120,652,115.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,533,446.30
转换费收入	112,083.01
合计	13,645,529.31

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	14,486,359.77
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	14,486,359.77

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	64,464.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
证券组合费_港股通	54,469.78
银行费用	32,894.72
合计	211,336.83

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

本基金管理人于 2021 年 6 月 17 日发布《银华基金管理股份有限公司关于银华国际资本管理有限公司增加注册资本的公告》，银华基金管理股份有限公司（以下简称“母公司”）已完成对银华国际资本管理有限公司（以下简称“香港子公司”）的增资工作，母公司向香港子公司增加注册资本金共港币 7,000 万元。增资完成后，母公司维持持股比例 100%，共持股 1 亿股，香港子公司注册资本为 1 亿元港币。

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、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

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
-------	----

	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
西南证券	248,594,390.39	2.90%

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 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	182,992.83	2.85%	13,916.55	0.50%

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 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	48,179,028.74
其中：支付销售机构的客户维护费	22,005,501.40

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,029,838.23

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	572,318,135.69	772,994.75

注：本基金的银行存款由基金管理人招商银行保管，按同业利率或约定利率计息。

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（2021 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	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
688131	皓元医药	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 8 日	新发流通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新发流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688533	上声电子	2021 年 4 月 9 日	2021 年 10 月 19 日	新发流通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688117	圣诺生物	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新发流通受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新发流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688685	迈信林	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 15 日	新发流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新发流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月	新发流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-

			月 15 日							
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新发流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新发流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新发流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新发流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新发流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-

300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新发流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新发流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新发流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新发流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新发流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新发流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新发流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新发流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新发流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-

301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新发流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新发流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新发流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新发流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新发流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新发流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新发流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-

			日							
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新发流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新发流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

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

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。

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约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 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	572,318,135.69	-	-	-	-	-	572,318,135.69
结算备付金	11,063,976.31	-	-	-	-	-	11,063,976.31
存出保证金	1,583,014.69	-	-	-	-	604,261.49	2,187,276.18
交易性金融资 产	14,794,000.00	-	-	-	-	4,832,882,271.90	4,847,676,271.90
应收证券清算 款	-	-	-	-	-	72,486,881.02	72,486,881.02
应收利息	-	-	-	-	-	361,436.63	361,436.63
应收申购款	2,176,645.29	-	-	-	-	5,888,960.54	8,065,605.83
资产总计	601,935,771.98	-	-	-	-	4,912,223,811.58	5,514,159,583.56
负债							
应付证券清算 款	-	-	-	-	-	14,496,066.60	14,496,066.60
应付赎回款	-	-	-	-	-	109,295,822.55	109,295,822.55
应付管理人报 酬	-	-	-	-	-	6,852,585.21	6,852,585.21
应付托管费	-	-	-	-	-	1,142,097.56	1,142,097.56
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,777,026.18	2,777,026.18
其他负债	-	-	-	-	-	498,178.53	498,178.53
负债总计	-	-	-	-	-	135,061,776.63	135,061,776.63
利率敏感度缺 口	601,935,771.98	-	-	-	-	4,777,162,034.95	5,379,097,806.93
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	620,647,161.35	-	-	-	-	-	620,647,161.35
结算备付金	10,027,569.39	-	-	-	-	-	10,027,569.39
存出保证金	1,496,036.69	-	-	-	-	-	1,496,036.69
交易性金融资 产	-	-	-	-	-	8,997,032,315.26	8,997,032,315.26
应收证券清算 款	-	-	-	-	-	163,536,702.12	163,536,702.12
应收利息	-	-	-	-	-	78,798.60	78,798.60
应收申购款	79,638.18	-	-	-	-	10,584,897.43	10,664,535.61
资产总计	632,250,405.61	-	-	-	-	9,171,232,713.41	9,803,483,119.02

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	332.66	332.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	233,958,062.74	233,958,062.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,300,442.10	12,300,442.10
应付托管费	-	-	-	-	-	2,050,073.65	2,050,073.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,964,604.70	5,964,604.70
应交税费	-	-	-	-	-	0.30	0.30
其他负债	-	-	-	-	-	715,751.42	715,751.42
负债总计	-	-	-	-	-	254,989,267.57	254,989,267.57
利率敏感度缺口	632,250,405.61	-	-	-	-	-8,916,243,445.84	9,548,493,851.45

6.4.13.4.1.2 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 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币 种 折合人民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	624,513,150.77	-	624,513,150.77
资产合计	-	624,513,150.77	-	624,513,150.77

以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	624, 513, 150. 77	-	624, 513, 150. 77

单位：人民币元

项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币 种 折合人 民币	合计
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	-	-	-	-
交易性金融资产	-	2, 153, 352, 436. 14	-	2, 153, 352, 436. 14
资产合计	-	2, 153, 352, 436. 14	-	2, 153, 352, 436. 14
以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2, 153, 352, 436. 14	-	2, 153, 352, 436. 14

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,832,882,271.90	89.85	8,997,032,315.26	94.22
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	14,794,000.00	0.28	—	—
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	4,847,676,271.90	90.12	8,997,032,315.26	94.22

6.4.13.4.3.2 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。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	401,863,421.72	359,925,201.33
	业绩比较基准下降 5%	-401,863,421.72	-359,925,201.33

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。

6.4.14 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	4,832,882,271.90	87.64
	其中：股票	4,832,882,271.90	87.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,794,000.00	0.27
	其中：债券	14,794,000.00	0.27
	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	583,382,112.00	10.58
8	其他各项资产	83,101,199.66	1.51
9	合计	5,514,159,583.56	100.00

7.2 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,147,351,225.35	58.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	28,465.12	0.00
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	22,407.83	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	259,115,423.77	4.82
N	水利、环境和公共设施管理业	21,451.02	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	801,745,744.90	14.90
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,208,369,121.13	78.24

7.2.2 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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	405,842,526.77	7.54
G 工业	-	-
H 信息技术	218,670,624.00	4.07
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	624,513,150.77	11.61

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	占基金资产净值比例（%）
1	600132	重庆啤酒	2,485,435	491,991,858.25	9.15
2	600519	贵州茅台	238,059	489,615,945.30	9.10
3	600809	山西汾酒	1,051,810	471,210,880.00	8.76
4	300347	泰格医药	2,434,903	470,666,749.90	8.75
5	02269	药明生物	3,202,000	379,132,758.77	7.05
6	688185	康希诺	443,081	344,615,109.37	6.41
7	300957	贝泰妮	1,246,671	338,691,214.30	6.30
8	000799	酒鬼酒	1,321,671	337,819,107.60	6.28
9	600763	通策医疗	805,545	331,078,995.00	6.15
10	603259	药明康德	1,651,653	258,632,343.27	4.81
11	00700	腾讯控股	450,000	218,670,624.00	4.07
12	300357	我武生物	2,166,913	138,942,461.56	2.58
13	600436	片仔癀	266,971	119,683,099.30	2.22
14	300630	普利制药	2,084,462	109,225,808.80	2.03

15	002568	百润股份	1,082,226	102,584,202.54	1.91
16	688169	石头科技	81,103	102,270,883.00	1.90
17	688166	博瑞医药	1,687,264	70,544,507.84	1.31
18	603919	金徽酒	715,238	29,410,586.56	0.55
19	01548	金斯瑞生物 科技	600,000	16,924,507.20	0.31
20	01951	锦欣生殖	600,000	9,785,260.80	0.18
21	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.01
22	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
23	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
24	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
25	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
26	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
27	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
28	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
29	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
30	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
31	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
32	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
33	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
34	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
35	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
36	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
37	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
38	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
39	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
40	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
41	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
42	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
43	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
44	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
45	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
46	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
47	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
48	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
49	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
50	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
51	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
52	300950	德固特	219	8,569.47	0.00

53	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
54	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
55	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
56	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
57	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
58	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
59	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
60	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
61	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
62	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
63	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
64	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
65	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
66	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
67	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
68	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
69	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
70	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
71	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
72	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
73	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
74	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	300957	贝泰妮	262,661,286.64	2.75
2	000799	酒鬼酒	251,692,764.26	2.64
3	688185	康希诺	203,239,447.44	2.13
4	00700	腾讯控股	196,505,002.13	2.06
5	03690	美团-W	176,391,979.77	1.85
6	688169	石头科技	132,477,375.10	1.39
7	002568	百润股份	97,745,407.36	1.02
8	000538	云南白药	81,209,675.38	0.85
9	603259	药明康德	79,848,051.26	0.84

10	000858	五粮液	72,230,999.00	0.76
11	600763	通策医疗	56,613,364.72	0.59
12	600702	舍得酒业	29,408,456.00	0.31
13	603919	金徽酒	28,923,474.72	0.30
14	600436	片仔癀	27,799,249.00	0.29
15	600132	重庆啤酒	27,059,862.30	0.28
16	01548	金斯瑞生物科技	17,395,422.21	0.18
17	300896	爱美客	10,112,381.00	0.11
18	01951	锦欣生殖	9,665,592.12	0.10
19	300630	普利制药	5,721,329.22	0.06
20	688819	天能股份	1,186,083.78	0.01

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	942,549,808.79	9.87
2	03690	美团-W	618,816,039.86	6.48
3	600809	山西汾酒	579,983,684.05	6.07
4	002352	顺丰控股	500,847,339.03	5.25
5	00700	腾讯控股	489,759,966.77	5.13
6	09633	农夫山泉	447,112,498.93	4.68
7	600519	贵州茅台	432,931,425.08	4.53
8	603288	海天味业	404,945,971.60	4.24
9	02269	药明生物	318,174,653.72	3.33
10	600132	重庆啤酒	299,654,054.87	3.14
11	300558	贝达药业	292,441,510.94	3.06
12	600276	恒瑞医药	275,335,105.84	2.88
13	600600	青岛啤酒	189,183,876.70	1.98
14	000799	酒鬼酒	151,262,689.28	1.58
15	600436	片仔癀	112,960,824.98	1.18
16	300347	泰格医药	104,486,859.22	1.09
17	002568	百润股份	75,606,146.75	0.79
18	000538	云南白药	69,130,981.98	0.72
19	600763	通策医疗	62,632,988.94	0.66
20	603520	司太立	57,793,292.78	0.61

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	1,774,887,486.40
卖出股票收入（成交）总额	6,807,866,291.56

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	14,794,000.00	0.28
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	14,794,000.00	0.28

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019640	20 国债 10	147,940	14,794,000.00	0.28

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	2,187,276.18
2	应收证券清算款	72,486,881.02
3	应收股利	—
4	应收利息	361,436.63
5	应收申购款	8,065,605.83
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	83,101,199.66

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300957	贝泰妮	214,921.88	0.00	新发流通受限

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
89,828	46,899.60	4,034,015.43	0.10%	4,208,863,384.06	99.90%

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	3,753,404.98	0.09%

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的情况

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2020 年 8 月 13 日 ）基金份额总额	9,885,942,504.25
本报告期期初基金份额总额	8,424,488,506.60
本报告期基金总申购份额	1,080,005,717.58
减：本报告期基金总赎回份额	5,291,596,824.69
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,212,897,399.49

注：本期申购中包含转入份额，本期赎回中包含转出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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，基金托管人无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 2021 年 1 月 15 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 15 日起在投资范围中增加存托凭证，并在投资策略中增加存托凭证相关投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期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	
申港证券股份有限公司	2	1,127,703,660.07	13.15%	824,689.06	12.83%	—
华西证券股份有限公司	4	1,102,635,068.89	12.86%	806,357.82	12.55%	—
华泰证券股份有限公司	4	1,096,102,175.33	12.78%	801,580.37	12.47%	—
国盛证券股份有限公司	2	987,308,030.30	11.51%	789,845.67	12.29%	新增 2 个交易单元

长江证券股份有限公司	4	760,674,079.80	8.87%	556,282.50	8.66%	-
开源证券股份有限公司	2	733,908,519.80	8.56%	587,125.56	9.13%	-
川财证券有限责任公司	2	599,071,903.66	6.99%	438,101.15	6.82%	-
安信证券股份有限公司	2	546,454,699.89	6.37%	437,164.78	6.80%	-
天风证券股份有限公司	2	493,395,737.81	5.75%	360,821.23	5.61%	-
东吴证券股份有限公司	2	438,653,290.46	5.12%	320,787.03	4.99%	-
西南证券股份有限公司	2	248,594,390.39	2.90%	182,992.83	2.85%	-
广发证券股份有限公司	2	122,526,012.65	1.43%	89,603.52	1.39%	-
中信建投证券股份有限公司	4	106,323,238.02	1.24%	77,754.14	1.21%	-
国信证券股份有限公司	2	96,060,580.58	1.12%	70,248.72	1.09%	-
德邦证券股份有限公司	2	76,326,074.61	0.89%	55,817.21	0.87%	-
东方证券股份有限公司	2	38,275,124.76	0.45%	27,990.33	0.44%	-
兴业证券股份有限公司	2	151,430.58	0.00%	110.74	0.00%	-
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易日单元
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易日单元
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易日单元
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易日单元
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易日单元
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易日单元
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易日单元
华龙证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
-------	--	--	--	--	--	--

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	9,282,777.70	62.79%	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	5,499,899.80	37.21%	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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修订旗下部分公募基金基金合同的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 15 日
2	《银华富利精选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 年 1 月 15 日
3	《银华富利精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	2021 年 1 月 15 日
4	《银华富利精选混合型证券投资基金托管协议(2021 年 1 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 15 日
5	《银华富利精选混合型证券投资基金	本基金管理人网站,	2021 年 1 月 15 日

	基金基金合同（2021 年 1 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站	
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021 年 1 月 20 日
7	《银华富利精选混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 20 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于银华富利精选混合型证券投资基金增加部分代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站， 证券时报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 26 日
9	《银华基金管理股份有限公司关于增加度小满基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站， 四大证券报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 3 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站， 四大证券报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 5 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加西安银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站， 上海证券报，证券时报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 25 日
12	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为银华富利精选混合型证券投资基金代销机构的公告》	本基金管理人网站， 证券时报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 2 月 25 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站， 上海证券报，证券时报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 9 日
14	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2021 年 3 月 29 日
15	《银华富利精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告》	本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 29 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站， 四大证券报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 30 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗	四大证券报	2021 年 4 月 21 日

	下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告》		
18	《银华富利精选混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
19	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加昆仑银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 证券时报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 23 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 27 日
21	《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, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 11 日
22	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 17 日
23	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 7 日
24	《银华基金管理股份有限公司关于增加天津银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 17 日
25	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资(如有)业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 28 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 2021 年 1 月 15 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 15 日起增加侧袋机制，在投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行了修订。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华富利精选混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华富利精选混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华富利精选混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华富利精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

12.2 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

2021 年 8 月 28 日