银华远景债券型证券投资基金
2020年年度报告

2020年12月31日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
送出日期：2021年3月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....7
3.1 主要会计数据和财务指标.....7
3.2 基金净值表现.....7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....9
§4 管理人报告.....10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....19
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....19
§5 托管人报告.....20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....20
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.....20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....20
§6 审计报告.....21
6.1 审计报告基本信息.....21
6.2 审计报告的基本内容.....21
§7 年度财务报表.....24
7.1 资产负债表.....24
7.2 利润表.....25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....26
7.4 报表附注.....27
§8 投资组合报告.....55
8.1 期末基金资产组合情况.....55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....63
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....63
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....64

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....64
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....64
8.11 投资组合报告附注.....64
§9 基金份额持有人信息.....66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....66
§10 开放式基金份额变动.....67
§11 重大事件揭示.....68
11.1 基金份额持有人大会决议.....68
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....68
11.4 基金投资策略的改变.....68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....68
11.8 其他重大事件.....70
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....77
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....77
§13 备查文件目录.....78
13.1 备查文件目录.....78
13.2 存放地点.....78
13.3 查阅方式.....78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华远景债券型证券投资基金
基金简称	银华远景债券
基金主代码	002501
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 1 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,920,611,268.24 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的投资及严格的风险控制，追求长期稳定的回报，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采用定量和定性相结合的分析方法，结合对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的定性分析，综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，本基金将积极主动地对固定收益类资产、现金和权益类资产等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。 本基金投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 20%，其中权证占基金资产净值的比例为 0%－3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	胡波
	联系电话	(010)58163000	(021)61618888
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95528

传真	(010)58163027	(021)63602540
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	上海市中山东一路 12 号
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	上海市北京东路 689 号
邮政编码	100738	200001
法定代表人	王珠林	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年	2019年	2018年
本期已实现收益	479,252,703.08	24,918,914.39	-23,118,193.24
本期利润	707,769,359.80	43,849,203.52	-7,159,460.63
加权平均基金份额本期利润	0.1084	0.1471	-0.0173
本期加权平均净值利润率	9.39%	13.20%	-1.68%
本期基金份额净值增长率	11.69%	14.01%	-1.16%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	249,738,610.36	15,240,678.05	665,743.51
期末可供分配基金份额利润	0.0280	0.0241	0.0031
期末基金资产净值	10,358,456,760.00	694,675,745.81	223,017,165.59
期末基金份额净值	1.161	1.098	1.025
3.1.3 累计期末指标	2020年末	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	30.53%	16.86%	2.50%

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

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

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

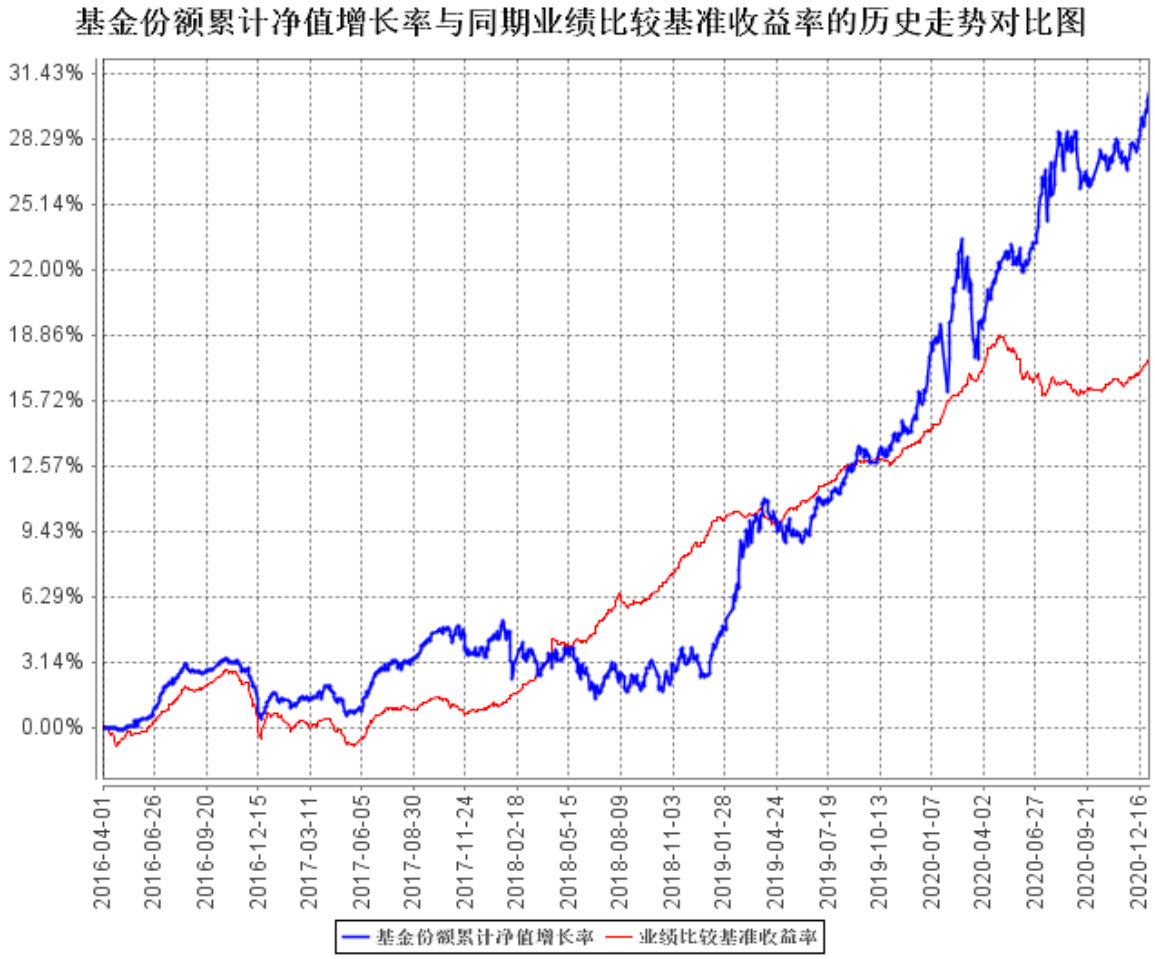
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.33%	0.23%	1.26%	0.05%	2.07%	0.18%

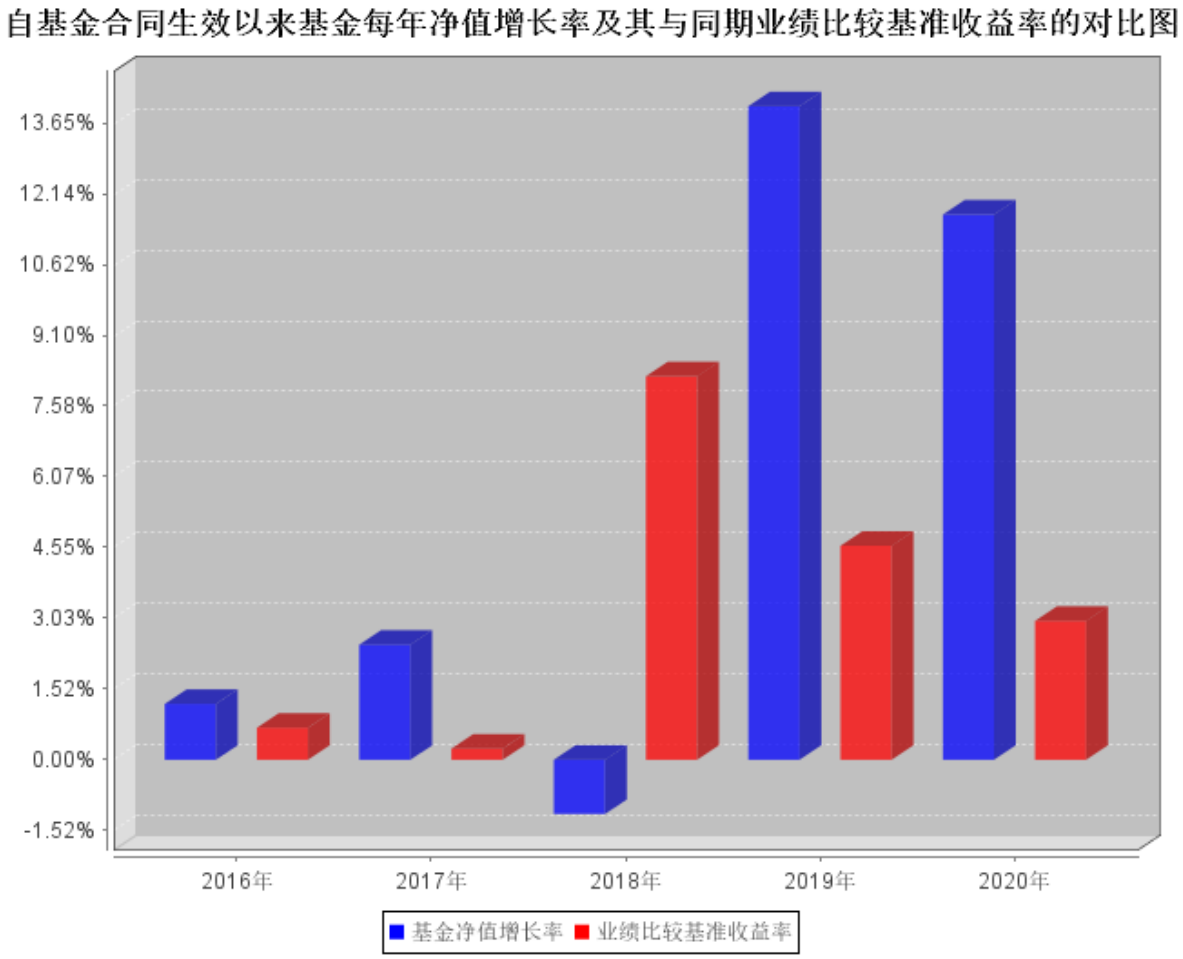
过去六个月	5.51%	0.34%	0.62%	0.07%	4.89%	0.27%
过去一年	11.69%	0.39%	2.98%	0.09%	8.71%	0.30%
过去三年	25.87%	0.30%	16.56%	0.07%	9.31%	0.23%
自基金合同生效起至今	30.53%	0.25%	17.66%	0.08%	12.87%	0.17%

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



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：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 20%，其中权证占基金资产净值的比例为 0%－3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020	0.6300	312,535,186.23	160,495,113.49	473,030,299.72	
2019	0.7000	36,498,936.81	1,278,600.42	37,777,537.23	
2018	-	-	-	-	
合计	1.3300	349,034,123.04	161,773,713.91	510,807,836.95	

注：本基金 2018 年度未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金管理人管理着 133 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 指数分级证券投资基金、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）、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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分级证券投资基金、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、银华文体娱乐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、银华智荟分红收益灵活配置混合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。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾鹏先生	本基金的基金经理	2020 年 1 月 6 日	-	12.5 年	硕士学位，2008 年 3 月至 2011 年 3 月期间任职于银华基金管理有限公司，担任行业研究员职务；2011 年 4 月至 2012 年 3 月期间任职于瑞银证券有限责任公司，担任行业研究组长；2012 年 4 月至 2014 年 6 月期间任职于建信基金管理有限公司，担任基金经理助理。2014 年 6 月起任职于银华基金管理有限公司，自 2014 年 8 月 27 日至 2017 年 8 月 7 日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自 2014 年 8 月 27 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2014 年 9

					月12日至2020年5月21日兼任银华增值证券投资基金基金经理，自2014年12月31日至2016年12月22日兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自2016年4月1日至2017年7月5日兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自2016年5月19日起兼任银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年8月8日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年12月14日起兼任银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年1月29日起兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2019年6月28日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自2020年1月6日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自2020年2月19日起兼任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理，自2020年9月10日起兼任银华多元机遇混合型证券投资基金基金经理，自2021年2月8日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
孙慧女士	本基金的基金经理	2016年12月22日	-	10.5年	硕士学位。2010年6月至2012年6月任职中邮人寿保险股份有限公司投资管理部，任投资经理助理；2012年7月至2015年2月任职于华夏人寿保险股份有限公司资产管理中心，任投资经理；2015年3月加盟银华基金管理有限公司，历任基金经理助理。自2016年2月6日至2017年8月7日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自2016年2月6日至2020年5月21日兼任银华增值证券投资基金基金经理，自2016年2月6日至2020年10月16日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自2016年10月17日至

					2018年2月5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2016年10月17日至2018年6月26日兼任银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理，自2016年12月22日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自2017年8月8日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月7日起兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2018年8月31日起兼任银华可转债债券型证券投资基金基金经理，自2019年6月28日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自2021年2月8日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理。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、《银华远景债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》，本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》，对投资部、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等，规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程，完善公平交易制度，确保各

投资组合享有公平的交易执行机会，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》，制定了《银华基金管理股份有限公司公平交易执行制度》，规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制；明确了交易执行环节的集中交易制度，并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外，为了加强对异常交易行为的日常监控，本基金管理人还制定了《银华基金管理股份有限公司异常交易监控实施细则》，规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备流程。

对照 2011 年 8 月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人又对上述制度进行了修改完善，进一步修订了公平交易的范围，修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点，并强调了本基金管理人内部控制的要求，具体控制方法为：1、交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现，不掺杂任何的人为判断，所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行，公平交易程序自动启动；2、一般情况下，场外交易指令以组合的名义下达，执行交易员以组合的名义进行一级市场申购投标及二级市场交易，并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应，且各投资组合获得公平的交易机会；3、对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、本基金管理人使用恒生 03.2 系统的公平交易稽核分析模块，定期及不定期进行报告分析，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

综上所述，本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督，来确保公平交易制度得到切实执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内，本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度，在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节，建立了健全有效的公平交易执行体系，公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下：

在研究分析环节，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。

在投资决策环节，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。

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，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2.2 同向交易价差专项分析

本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内（1日内、3日内及5日内）同向交易的交易价差从T检验（置信度为95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有1次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在过去的2020年，一场疫情改变了世界，投资所面临的宏观环境，是“差的基本面+超级宽松流动性”的组合，股票市场走势震荡起伏、一波三折。全年看，创业板指、上证指数分别上涨64.96%、13.87%，创业板指大幅领涨。同时市场呈现极端分化的格局，消费与成长年内分别上涨48.05% 与41.41%，整体表现大幅优于周期和金融。28个申万行业中共21个行业收涨，休闲服务、电气设备、食品饮料行业涨幅居前，且均超过80%，同时仍有房地产、通信、纺织服装等7个行业是下跌的。

2020年我们经历了历史上少见的股票市场牛市，很多人的收益率堪比2015年。虽然投资时钟对债券有利，但在一个本身较低的债券利率下，叠加信用债风险暴露，债券市场的波动超出预期。在过去的一年，本基金在2020年总体维持了较高的股票仓位，主要配置了优质行业的龙头个股；债券投资方面，本基金主要以中高等级信用债为主，获取了合理的收益，并随市场行情变化对纯债与转债仓位进行了相对调整，同时对持仓结构进行了优化。

我们的投资风格：

我们管理的所有产品，在投资目标上是统一的，追求较好的长期年化复合收益。投资目标决定了投资行为，我们不以短期的排名作为目的，而是希望基金净值在一个长的时间内，相对稳健的保持增长；当然，我们也希望基金的复合收益率，长期是具备吸引力的。

不管是我们的偏股基金，还是二级债基，我们始终坚持既有的投资风格——平衡稳健，在净值增长和波动之间保持一定的平衡，在获得较高收益的同时，净值回撤相对可控，为投资者提供更好的体验。这种做法当然限制了我们获得更高的收益率，但是也让大部分客户能够安心持有，不至于震荡出局。我们努力追求，自己能成客户的底仓配置，为每一个平凡的生活梦想助力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.161 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.69%，业绩比较基准收益率为 2.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场展望：

2021 年的投资难度，会大幅高于过去的两年，我们对收益率的预期也大幅下降。

2021 年投资面临的有利环境包括：

（1）疫情大概率得到控制，我们对新冠疫苗抱有比较大的期待。虽然大部分疫苗从启动到上市，时间只有一年左右，但是临床数据表明，已经获批和可能获批的若干种疫苗，在安全性和有效性方面都表现不错。各国政府会抓住机会，快速推进疫苗的注射工作，抢在可能的病毒变异之前，完成群体免疫。全球经济活跃度是一根弹簧，经历了疫情长时间的压缩，现在开始逐步恢复活力了。

（2）我们面临的外部环境有所缓和。虽然不能回到贸易摩擦之前，拜登上台之后，特朗普的一些做法多少会得到修正，这对全球经济都是好事。

（3）中国经济增长的质量在提高。我们在第二篇文章提到了几个重要的长期增长动能，包括：居民消费能力的释放；资本市场改革带来直接融资的发展，能不断推动创新型企业的发展；居民资产配置缓慢发生变化，财产性收入长期提升。这些共同构成经济转型和持续增长的强大力量。

但同时，我们认为 2021 年投资的难度要大幅高于过去两年，是因为：

（1）经过两年的大幅上涨，股票市场的估值已经不算便宜，特别是主要的优质公司，估值都在历史偏高的水平。

（2）在疫情逐步控制，经济恢复增长之后，流动性环境可能会发生转折。在这种背景下，权益市场要想估值扩张，难度很大。

（3）虽然经济总体的杠杆率不高，但部分经济效益较差的企业，在过去积累了较大债务规模，如果流动性开始收紧，局部信用风险值得关注。

我们在 2021 年的投资策略：

2020 年已经过去，我们需要忘掉过去两年的高收益，放低预期，更为审慎的对待 2021 年的投资机会。欲至千里，不急一时。

债券投资方面， 短期以票息策略为主，同时关注阶段性预期差变化带来的机会以及品种利差轮动机会。中期随基本面变化，在资产配置与宏观运行阶段的视角下，不过度看空债券资产，注重其不断优化的配置价值，紧密观察系统性提升配置水平的机会出现。此外，也将继续积极运用可转债等工具增厚投资组合收益。

股票投资方面，我们总体会保持中性偏高的股票仓位，如果股票市场估值过高，我们也会阶段性降低股票投资比例。投资机会我们重点关注三个方向：一是 2020 年因疫情受损的可选消费品，如大众消费品、餐饮、酒店等板块，随着疫情的修复，这些板块的业绩也有望同步恢复。二是在科技领域，重点关注电动车和光伏板块。虽然短期涨幅较大，有一定的回调风险，但是长期看还是非常好的赛道。三是在低估值的股票中，我们关注保险、银行投资机会，认为在经济周期上行阶段，这些板块表现相对会较好。特别强调一下，我们长期看好港股的投资机会，在目前阶段，我们能投港股的产品中，会加大港股配置比例。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人于2020年4月27日发布分红公告，向于2020年4月28日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每10份基金份额分配红利人民币0.23元，实际分配收益金额为人民币118,869,475.84元。于2020年12月4日发布分红公告，向于2020年12月7日在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人，按每10份基金份额分配红利人民币0.40元，实际分配收益金额为人民币354,160,823.88元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对银华远景债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对银华远景债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行利润分配，分配金额为人民币 473,030,299.72 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由银华基金管理股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(21)第 01414 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华远景债券型证券投资基金全体持有人：
审计意见	我们审计了银华远景债券型证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了银华远景债券型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华远景债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括银华远景债券型证券投资基金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银华远景债券型

	证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算银华远景债券型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督银华远景债券型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对银华远景债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华远景债券型证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容并评价财务

	报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	郝琪	杨婧
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华远景债券型证券投资基金

报告截止日： 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	4,216,080.01	58,163,587.76
结算备付金		183,445,253.14	11,163,322.25
存出保证金		1,826,432.99	66,533.61
交易性金融资产	7.4.7.2	11,784,255,064.04	896,050,791.17
其中：股票投资		1,627,686,817.02	130,327,151.92
基金投资		-	-
债券投资		10,156,568,247.02	765,723,639.25
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	47,000,000.00	15,190,000.00
应收证券清算款		118,546,284.73	-
应收利息	7.4.7.5	144,068,953.96	11,705,740.58
应收股利		-	-
应收申购款		35,010,778.20	205,592.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		12,318,368,847.07	992,545,568.16
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020年12月31日**	**上年度末 2019年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,836,200,000.00	240,000,000.00
应付证券清算款		100,670,392.78	57,174,624.61
应付赎回款		15,460,248.02	36,259.61
应付管理人报酬		4,324,196.28	261,205.87
应付托管费		864,839.25	52,241.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,096,118.14	143,393.40
应交税费		766,317.98	50,229.77
应付利息		-701,632.03	-18,159.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	231,606.65	170,027.13
负债合计		1,959,912,087.07	297,869,822.35
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	8,920,611,268.24	632,486,128.21
未分配利润	7.4.7.10	1,437,845,491.76	62,189,617.60
所有者权益合计		10,358,456,760.00	694,675,745.81

负债和所有者权益总计		12,318,368,847.07	992,545,568.16

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.161元，基金份额总额8,920,611,268.24份。

7.2 利润表

会计主体：银华远景债券型证券投资基金

本报告期： 2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020年1月1日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
一、收入		794,751,953.62	48,758,936.59
1.利息收入		231,300,257.46	12,639,391.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,592,150.86	193,971.76
债券利息收入		226,940,983.96	12,425,747.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,767,122.64	19,671.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		333,747,022.93	17,188,421.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	297,921,930.56	8,545,017.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	23,692,566.65	8,294,576.80
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	12,132,525.72	348,827.38

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	228,516,656.72	18,930,289.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,188,016.51	834.81
减：二、费用		86,982,593.82	4,909,733.07
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	37,205,428.89	1,653,632.14
2．托管费	7.4.10.2.2	7,441,085.71	330,726.40
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	13,924,080.53	476,059.23
5．利息支出		27,374,581.06	2,194,203.83
其中：卖出回购金融资产支出		27,374,581.06	2,194,203.83
6．税金及附加		739,227.08	40,078.47
7．其他费用	7.4.7.20	298,190.55	215,033.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		707,769,359.80	43,849,203.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		707,769,359.80	43,849,203.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华远景债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	632,486,128.21	62,189,617.60	694,675,745.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	707,769,359.80	707,769,359.80
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）	8,288,125,140.03	1,140,916,814.08	9,429,041,954.11
其中：1.基金申购款	12,602,157,099.76	1,812,175,336.22	14,414,332,435.98
2.基金赎回款	-4,314,031,959.73	-671,258,522.14	-4,985,290,481.87
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）	-	-473,030,299.72	-473,030,299.72
五、期末所有者权益（基金净值）	8,920,611,268.24	1,437,845,491.76	10,358,456,760.00
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	217,477,447.68	5,539,717.91	223,017,165.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,849,203.52	43,849,203.52
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）	415,008,680.53	50,578,233.40	465,586,913.93
其中：1.基金申购款	417,498,731.83	50,912,095.78	468,410,827.61
2.基金赎回款	-2,490,051.30	-333,862.38	-2,823,913.68
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）	-	-37,777,537.23	-37,777,537.23
五、期末所有者权益（基金净值）	632,486,128.21	62,189,617.60	694,675,745.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____王立新_____ _____凌宇翔_____ ____伍军辉

____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华远景债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《银华远景债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，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[2016]367 号文批准公开发行。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为 200,141,408.40 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所验证。基金合同于 2016 年 4 月 1 日正式生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华远景债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：国内依法发行上市的股票(包括主板股票、中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、债券回购、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)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)。其中，债券资产包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 20%，其中权证占基金资产净值的比例为 0%－3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准是中债综合财富指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债)，并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2)金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金暂无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。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认

金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及收到的全部股利和利息计入相关损益，贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第 1 层次：输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第 2 层次：输入值是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 3 层次：输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金主要金融工具的估值方法如下：

1.股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值；

(3)流通受限股票的估值

对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

2.债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

3.权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2)未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值；

(3)因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4.分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2、3中的相关原则进行估值。

5.其他

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

(2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在实际持有期间内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入

账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认；

(8)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(11)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投方式免收再投资的费用；

(2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去没单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3)每一基金份额享有同等分配权；

(4)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税；

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

(3)本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	4,216,080.01	58,163,587.76
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,216,080.01	58,163,587.76

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,365,036,956.66	1,627,686,817.02	262,649,860.36
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,265,919,997.61	5,277,252,247.02	11,332,249.41
	银行间市场	4,904,981,033.16	4,879,316,000.00	-25,665,033.16
	合计	10,170,901,030.77	10,156,568,247.02	-14,332,783.75
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		11,535,937,987.43	11,784,255,064.04	248,317,076.61
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		116,909,687.44	130,327,151.92	13,417,464.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	461,189,863.08	466,435,639.25	5,245,776.17
	银行间市场	298,150,820.76	299,288,000.00	1,137,179.24
	合计	759,340,683.84	765,723,639.25	6,382,955.41
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		876,250,371.28	896,050,791.17	19,800,419.89

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	47,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	47,000,000.00	-

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,190,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	15,190,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	16,565.81	7,977.92
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	90,805.44	5,525.85
应收债券利息	144,003,266.83	11,692,112.21
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-43,488.48	-
应收申购款利息	900.27	91.71
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	904.09	32.89
合计	144,068,953.96	11,705,740.58

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,076,870.76	139,418.17
银行间市场应付交易费用	19,247.38	3,975.23
合计	2,096,118.14	143,393.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	11,606.65	27.13
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	170,000.00
合计	231,606.65	170,027.13

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	632,486,128.21	632,486,128.21
本期申购	12,602,157,099.76	12,602,157,099.76
本期赎回（以“-”号填列）	-4,314,031,959.73	-4,314,031,959.73
- 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	8,920,611,268.24	8,920,611,268.24

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

7.4.7.10 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	15,240,678.05	46,948,939.55	62,189,617.60
本期利润	479,252,703.08	228,516,656.72	707,769,359.80
本期基金份额交易产生的变动数	228,275,528.95	912,641,285.13	1,140,916,814.08
其中：基金申购款	385,616,755.88	1,426,558,580.34	1,812,175,336.22
基金赎回款	-157,341,226.93	-513,917,295.21	-671,258,522.14
本期已分配利润	-473,030,299.72	-	-473,030,299.72
本期末	249,738,610.36	1,188,106,881.40	1,437,845,491.76

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	955,198.87	68,262.89
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	1,581,922.62	121,967.49
其他	55,029.37	3,741.38
合计	2,592,150.86	193,971.76

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	297,921,930.56	8,545,017.41
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	297,921,930.56	8,545,017.41

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,513,390,454.98	122,959,658.72
减：卖出股票成本总额	4,215,468,524.42	114,414,641.31
买卖股票差价收入	297,921,930.56	8,545,017.41

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	23,692,566.65	8,294,576.80
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	23,692,566.65	8,294,576.80

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,786,826,506.80	481,464,106.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,680,949,333.81	463,909,695.34
减：应收利息总额	82,184,606.34	9,259,834.17
买卖债券差价收入	23,692,566.65	8,294,576.80

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	12,132,525.72	348,827.38

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	12,132,525.72	348,827.38

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	228,516,656.72	18,930,289.13
——股票投资	249,232,395.88	14,628,261.06
——债券投资	-20,715,739.16	4,302,028.07
——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	228,516,656.72	18,930,289.13

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,158,809.97	757.87
转换费收入	29,206.54	76.94
合计	1,188,016.51	834.81

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	13,852,280.53	466,134.23
银行间市场交易费用	71,800.00	9,925.00

交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	13,924,080.53	476,059.23

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行费用	40,990.55	7,833.00
合计	298,190.55	215,033.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司(“西南证券”)	基金管理人股东
第一创业证券股份有限公司(“第一创业”)	基金管理人股东
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人股东
山西海鑫实业有限公司(注 2)	基金管理人股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人、基金代销机构
银华长安资本管理(北京)有限公司(注 1)	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

注 1：根据 2020 年 10 月 24 日《银华基金管理股份有限公司关于子公司名称、住所及法定代表人变更的公告》，子公司银华资本管理(珠海横琴)有限公司更名为银华长安资本管理(北京)有限公司。

注 2：根据 2020 年 12 月 2 日《银华基金管理股份有限公司关于股东名称变更的公告》，股东山西海鑫实业股份有限公司更名为山西海鑫实业有限公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东北证券	4,463,150,645.27	44.95%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东北证券	5,156,337,876.96	50.87%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东北证券	201,167,200,000.00	74.99%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券	3,263,908.57	39.07%	1,964,505.94	94.59%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	37,205,428.89	1,653,632.14
其中：支付销售机构的客户维护费	828,731.04	1,817.92

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.50%/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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付	7,441,085.71	330,726.40

的托管费		

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%/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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	4,216,080.01	955,198.87	58,163,587.76	68,262.89

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					

1	2020 年 12 月 7 日	-	2020 年 12 月 7 日	0.4000	227,578,882.52	126,581,941.36	354,160,823.88	
2	2020 年 4 月 28 日	-	2020 年 4 月 28 日	0.2300	84,956,303.71	33,913,172.13	118,869,475.84	
合计	-	-		0.6300	312,535,186.23	160,495,113.49	473,030,299.72	

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 15 日	定向增发流通受限	100.00	100.00	16,950	1,695,000.00	1,695,000.00	-

注:截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限股票和权证。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,836,200,000.00 元，于 2021 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金

资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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	4,216,080.01	-	-	-	-	-	4,216,080.01

行存款							
结算备付金	183,445,253.14	-	-	-	-	-	183,445,253.14
存出保证金	1,826,432.99	-	-	-	-	-	1,826,432.99
交易性金融资产	600,607,925.10	268,222,046.40	294,045,479.42	8,490,200,290.17	503,492,505.93	1,627,686,817.02	11,784,255,064.04
买入返售金融资产	47,000,000.00	-	-	-	-	-	47,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	118,546,284.73	118,546,284.73
应收利息	-	-	-	-	-	144,068,953.96	144,068,953.96
应收申购款	35,004,466.21	-	-	-	-	6,311.99	35,010,778.20

资产总计	872,100,157.45	268,222,046.40	294,045,479.42	8,490,200,290.17	503,492,505.93	1,890,308,367.70	12,318,368,847.07
负债							
卖出回购金融资产款	1,836,200,000.00	-	-	-	-	-	1,836,200,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	100,670,392.78	100,670,392.78
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,460,248.02	15,460,248.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,324,196.28	4,324,196.28
应付托管费	-	-	-	-	-	864,839.25	864,839.25
应付交易费	-	-	-	-	-	2,096,118.14	2,096,118.14

用							
应付利息	-	-	-	-	-	-701,632.03	-701,632.03
应交税费	-	-	-	-	-	766,317.98	766,317.98
其他负债	-	-	-	-	-	231,606.65	231,606.65
负债总计	1,836,200,000.00	-	-	-	-	123,712,087.07	1,959,912,087.07
利率敏感度缺口	-964,099,842.55	268,222,046.40	294,045,479.42	8,490,200,290.17	503,492,505.93	1,766,596,280.63	10,358,456,760.00
上年度末2019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	58,163,587.76	-	-	-	-	-	58,163,587.76
结算备	11,163,322.25	-	-	-	-	-	11,163,322.25

付金							
存出保证金	66,533.61	-	-	-	-	-	66,533.61
交易性金融资产	8,745,540.40	0.00	50,223,443.90	677,840,669.97	28,913,984.98	130,327,151.92	896,050,791.17
买入返售金融资产	15,190,000.00	-	-	-	-	-	15,190,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	11,705,740.58	11,705,740.58
应收申购款	45,494,101.62	-	-	-	-	-45,288,508.83	205,592.79
资产总计	138,823,085.64	-	50,223,443.90	677,840,669.97	28,913,984.98	96,744,383.67	992,545,568.16
负债							
卖出回购金融资	240,000,000.00	-	-	-	-	-	240,000,000.00

产款							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	57,174,624.61	57,174,624.61
应付赎回款	-	-	-	-	-	36,259.61	36,259.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	261,205.87	261,205.87
应付托管费	-	-	-	-	-	52,241.16	52,241.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	143,393.40	143,393.40
应付利息	-	-	-	-	-	-18,159.20	-18,159.20
应交税费	-	-	-	-	-	50,229.77	50,229.77
其他负债	-	-	-	-	-	170,027.13	170,027.13

负债总计	240,000,000.00	-	-	-	-	57,869,822.35	297,869,822.35
利率敏感度缺口	-101,176,914.36	-	50,223,443.90	677,840,669.97	28,913,984.98	38,874,561.32	694,675,745.81

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
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（ 2020 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	+25 个基点	-51,785,302.39	-3,337,397.49
	-25 个基点	51,785,302.39	3,337,397.49

7.4.13.4.2 其他价格风险

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

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	1,627,686,817.02	15.71	130,327,151.92	18.76
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	10,156,568,247.02	98.05	765,723,639.25	110.23
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	11,784,255,064.04	113.76	896,050,791.17	128.99

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2020年12月31日 ）	上年度末（ 2019年12月31日 ）
	业绩比较基准上升5%	-429,225,517.92	-22,219,650.44
	业绩比较基准下降5%	429,225,517.92	22,219,650.44

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

本基金非以公允价值计量的金融工具，公允价值与账面价值相若。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币2,682,298,264.74元，第二层次的余额为人民币9,101,956,799.30元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：属于第一层次的余额为人民币309,161,047.67元，第二层次的余额为人民币586,889,743.50元，无属于第三层次的余额)。

本基金持有的金融工具公允价值的估值技术及输入值参见7.4.4.5。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

无。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金管理人批准报出。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,627,686,817.02	13.21
	其中：股票	1,627,686,817.02	13.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,156,568,247.02	82.45
	其中：债券	10,156,568,247.02	82.45
	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	47,000,000.00	0.38
	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	187,661,333.15	1.52
8	其他各项资产	299,452,449.88	2.43
9	合计	12,318,368,847.07	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	187,186,777.57	1.81
C	制造业	848,878,715.24	8.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,699,979.62	0.15
H	住宿和餐饮业	24,433,980.10	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,916,064.93	0.45
J	金融业	364,759,722.65	3.52
K	房地产业	6,281,489.20	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	106,212,370.72	1.03

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	5,089,216.99	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	22,228,500.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	1,627,686,817.02	15.71

8.2.2 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投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,247,704	108,525,293.92	1.05
2	600519	贵州茅台	51,779	103,454,442.00	1.00
3	603259	药明康德	732,896	98,735,749.12	0.95
4	600036	招商银行	1,931,739	84,899,929.05	0.82
5	600176	中国巨石	4,198,565	83,803,357.40	0.81
6	600988	赤峰黄金	4,653,615	83,346,244.65	0.80
7	000858	五粮液	285,210	83,238,538.50	0.80
8	300699	光威复材	891,275	79,368,038.75	0.77
9	000001	平安银行	2,897,970	56,046,739.80	0.54
10	601899	紫金矿业	5,474,110	50,854,481.90	0.49
11	601601	中国太保	1,269,150	48,735,360.00	0.47
12	601939	建设银行	7,429,281	46,655,884.68	0.45
13	000333	美的集团	467,497	46,020,404.68	0.44
14	300395	菲利华	712,776	42,645,388.08	0.41
15	688012	中微公司	268,816	42,362,713.44	0.41
16	002007	华兰生物	997,740	42,144,537.60	0.41
17	000661	长春高新	71,965	32,305,808.15	0.31
18	601012	隆基股份	332,371	30,644,606.20	0.30
19	601799	星宇股份	152,653	30,606,926.50	0.30
20	603517	绝味食品	374,300	29,023,222.00	0.28
21	300750	宁德时代	79,496	27,911,840.56	0.27
22	600754	锦江酒店	474,170	24,433,980.10	0.24
23	002555	三七互娱	768,095	23,987,606.85	0.23
24	601088	中国神华	1,317,991	23,737,017.91	0.23
25	002475	立讯精密	408,885	22,946,626.20	0.22
26	002410	广联达	291,192	22,928,458.08	0.22

27	600028	中国石化	5,643,321	22,742,583.63	0.22
28	300413	芒果超媒	306,600	22,228,500.00	0.21
29	000830	鲁西化工	1,592,100	20,347,038.00	0.20
30	601009	南京银行	2,462,440	19,896,515.20	0.19
31	300775	三角防务	493,085	19,437,410.70	0.19
32	600872	中炬高新	265,553	17,699,107.45	0.17
33	603345	安井食品	89,800	17,319,726.00	0.17
34	600009	上海机场	207,507	15,699,979.62	0.15
35	000338	潍柴动力	965,125	15,239,323.75	0.15
36	000596	古井贡酒	48,593	13,217,296.00	0.13
37	600426	华鲁恒升	284,600	10,615,580.00	0.10
38	002493	荣盛石化	383,000	10,574,630.00	0.10
39	600309	万华化学	106,567	9,701,859.68	0.09
40	603986	兆易创新	48,900	9,657,750.00	0.09
41	688179	阿拉丁	93,692	7,476,621.60	0.07
42	601225	陕西煤业	696,622	6,506,449.48	0.06
43	600048	保利地产	397,060	6,281,489.20	0.06
44	002460	赣锋锂业	59,818	6,053,581.60	0.06
45	000526	紫光学大	97,141	5,089,216.99	0.05
46	600438	通威股份	66,050	2,538,962.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	196,847,384.42	28.34
2	601318	中国平安	131,511,619.24	18.93
3	601012	隆基股份	121,691,893.32	17.52
4	600009	上海机场	118,343,666.34	17.04
5	600176	中国巨石	114,210,289.61	16.44
6	002007	华兰生物	112,859,804.34	16.25
7	002460	赣锋锂业	109,997,729.70	15.83
8	600519	贵州茅台	107,479,212.09	15.47
9	600872	中炬高新	106,390,221.35	15.32
10	600900	长江电力	104,250,359.41	15.01
11	600988	赤峰黄金	102,945,603.58	14.82
12	000001	平安银行	95,158,388.29	13.70
13	603259	药明康德	94,542,268.26	13.61

14	300699	光威复材	93,559,039.43	13.47
15	601601	中国太保	83,286,713.30	11.99
16	601899	紫金矿业	83,130,297.70	11.97
17	002555	三七互娱	82,216,340.04	11.84
18	603444	吉比特	81,703,990.27	11.76
19	002410	广联达	78,354,906.14	11.28
20	000651	格力电器	78,226,623.78	11.26
21	688012	中微公司	76,526,964.44	11.02
22	600036	招商银行	75,873,627.14	10.92
23	000858	五粮液	75,555,925.68	10.88
24	000661	长春高新	74,259,071.26	10.69
25	601939	建设银行	73,028,859.62	10.51
26	300413	芒果超媒	72,047,339.85	10.37
27	300750	宁德时代	70,475,705.19	10.15
28	002475	立讯精密	69,870,951.95	10.06
29	000895	双汇发展	69,222,700.95	9.96
30	600048	保利地产	66,592,756.19	9.59
31	600754	锦江酒店	64,846,925.69	9.33
32	000338	潍柴动力	64,594,579.12	9.30
33	601628	中国人寿	63,930,221.06	9.20
34	600926	杭州银行	59,117,693.50	8.51
35	300395	菲利华	57,558,034.45	8.29
36	002271	东方雨虹	54,747,832.92	7.88
37	000596	古井贡酒	52,989,015.06	7.63
38	002241	歌尔股份	49,441,830.97	7.12
39	002180	纳思达	49,384,849.91	7.11
40	600887	伊利股份	48,804,024.30	7.03
41	300433	蓝思科技	48,102,968.91	6.92
42	603233	大参林	47,417,069.57	6.83
43	300326	凯利泰	45,900,679.08	6.61
44	002982	湘佳股份	44,994,962.91	6.48
45	300450	先导智能	44,835,386.59	6.45
46	603345	安井食品	43,723,411.78	6.29
47	002385	大北农	43,542,572.10	6.27
48	603517	绝味食品	42,000,393.26	6.05
49	000547	航天发展	41,900,800.74	6.03
50	600028	中国石化	41,757,618.68	6.01
51	601088	中国神华	41,681,083.48	6.00

52	601225	陕西煤业	41,607,847.00	5.99
53	601668	中国建筑	40,327,010.79	5.81
54	000333	美的集团	39,320,643.10	5.66
55	000002	万科A	36,110,833.17	5.20
56	688008	澜起科技	34,427,043.15	4.96
57	600837	海通证券	34,005,325.82	4.90
58	603538	美诺华	33,967,257.37	4.89
59	601865	福莱特	32,540,141.48	4.68
60	300383	光环新网	32,148,939.11	4.63
61	601238	广汽集团	31,692,567.85	4.56
62	600438	通威股份	31,363,737.18	4.51
63	000403	双林生物	30,517,531.88	4.39
64	002138	顺络电子	29,955,459.00	4.31
65	603369	今世缘	29,240,581.00	4.21
66	600597	光明乳业	28,971,540.26	4.17
67	000988	华工科技	26,267,570.88	3.78
68	601799	星宇股份	26,178,746.99	3.77
69	603456	九洲药业	26,167,330.40	3.77
70	002008	大族激光	24,415,658.81	3.51
71	601100	恒立液压	23,693,881.61	3.41
72	300010	豆神教育	23,630,999.07	3.40
73	002311	海大集团	23,601,442.62	3.40
74	002299	圣农发展	22,363,471.38	3.22
75	000636	风华高科	22,018,109.00	3.17
76	600183	生益科技	21,900,175.00	3.15
77	300775	三角防务	21,843,465.16	3.14
78	300724	捷佳伟创	21,281,921.70	3.06
79	300073	当升科技	20,954,890.88	3.02
80	601009	南京银行	20,827,596.48	3.00
81	002714	牧原股份	20,507,971.00	2.95
82	000830	鲁西化工	20,500,121.22	2.95
83	002511	中顺洁柔	20,455,811.18	2.94
84	600104	上汽集团	20,444,075.33	2.94
85	300709	精研科技	20,205,210.10	2.91
86	002049	紫光国微	19,806,346.80	2.85
87	601952	苏垦农发	19,476,562.00	2.80
88	688111	金山办公	19,169,190.54	2.76
89	002041	登海种业	18,838,282.60	2.71

90	000998	隆平高科	18,604,841.27	2.68
91	603596	伯特利	18,418,363.94	2.65
92	000100	TCL 科技	17,759,197.00	2.56
93	603160	汇顶科技	17,623,916.18	2.54
94	002594	比亚迪	17,256,976.61	2.48
95	603866	桃李面包	16,362,820.48	2.36
96	300674	宇信科技	16,269,722.00	2.34
97	603986	兆易创新	16,195,329.68	2.33
98	600258	首旅酒店	16,024,189.85	2.31
99	002851	麦格米特	15,831,359.78	2.28
100	300792	壹网壹创	15,468,119.25	2.23
101	688029	南微医学	15,349,500.07	2.21
102	002050	三花智控	15,086,468.49	2.17
103	300759	康龙化成	14,663,731.40	2.11
104	603806	福斯特	14,389,164.80	2.07
105	000526	紫光学大	14,160,628.00	2.04

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	211,916,530.33	30.51
2	002460	赣锋锂业	115,788,780.52	16.67
3	600900	长江电力	112,394,261.64	16.18
4	601012	隆基股份	112,285,811.96	16.16
5	600009	上海机场	105,087,359.94	15.13
6	600872	中炬高新	88,212,216.09	12.70
7	000895	双汇发展	87,329,403.23	12.57
8	603444	吉比特	84,746,011.00	12.20
9	601628	中国人寿	84,291,551.93	12.13
10	000651	格力电器	72,813,279.68	10.48
11	600176	中国巨石	70,362,981.06	10.13
12	600988	赤峰黄金	69,694,625.89	10.03
13	002271	东方雨虹	68,287,302.25	9.83
14	300750	宁德时代	68,098,708.16	9.80
15	600048	保利地产	66,154,384.39	9.52
16	000661	长春高新	66,124,916.33	9.52
17	002475	立讯精密	65,319,505.04	9.40
18	300413	芒果超媒	64,825,061.82	9.33

19	600926	杭州银行	64,291,902.61	9.25
20	002410	广联达	63,661,934.40	9.16
21	600887	伊利股份	61,292,243.10	8.82
22	002007	华兰生物	60,044,679.57	8.64
23	300433	蓝思科技	58,967,715.61	8.49
24	002241	歌尔股份	58,435,592.95	8.41
25	601899	紫金矿业	53,014,973.91	7.63
26	000338	潍柴动力	51,484,643.23	7.41
27	603345	安井食品	49,673,243.44	7.15
28	000596	古井贡酒	49,646,860.99	7.15
29	002180	纳思达	48,204,134.49	6.94
30	600754	锦江酒店	47,723,534.88	6.87
31	603233	大参林	47,363,076.43	6.82
32	000547	航天发展	46,595,260.13	6.71
33	002385	大北农	45,076,463.03	6.49
34	688012	中微公司	44,694,927.98	6.43
35	002982	湘佳股份	44,146,819.63	6.36
36	002555	三七互娱	43,840,793.64	6.31
37	600438	通威股份	43,552,124.08	6.27
38	600519	贵州茅台	43,084,822.01	6.20
39	000001	平安银行	41,824,269.30	6.02
40	300326	凯利泰	41,580,756.80	5.99
41	601601	中国太保	41,529,202.51	5.98
42	000403	双林生物	41,464,733.79	5.97
43	601668	中国建筑	39,433,862.17	5.68
44	002311	海大集团	39,169,442.17	5.64
45	000002	万科A	38,148,417.29	5.49
46	300450	先导智能	36,959,303.93	5.32
47	603456	九洲药业	35,964,758.48	5.18
48	688008	澜起科技	34,673,897.33	4.99
49	002138	顺络电子	34,150,873.51	4.92
50	601318	中国平安	33,818,000.82	4.87
51	603369	今世缘	33,814,580.37	4.87
52	300383	光环新网	33,683,567.77	4.85
53	603538	美诺华	33,624,123.75	4.84
54	603259	药明康德	33,440,281.65	4.81
55	601225	陕西煤业	33,428,642.52	4.81
56	600837	海通证券	30,636,546.94	4.41
57	601100	恒立液压	30,333,074.59	4.37
58	000858	五粮液	29,759,877.73	4.28
59	601865	福莱特	29,474,043.16	4.24

60	000988	华工科技	29,437,941.91	4.24
61	600597	光明乳业	29,122,059.60	4.19
62	002714	牧原股份	28,790,859.71	4.14
63	300395	菲利华	27,015,512.96	3.89
64	601238	广汽集团	26,921,132.06	3.88
65	300073	当升科技	26,392,774.90	3.80
66	300699	光威复材	25,713,004.95	3.70
67	002008	大族激光	24,647,487.02	3.55
68	601939	建设银行	23,118,767.86	3.33
69	002299	圣农发展	22,521,718.23	3.24
70	600183	生益科技	22,385,468.41	3.22
71	000636	风华高科	21,921,551.40	3.16
72	300010	豆神教育	21,481,973.48	3.09
73	688111	金山办公	21,137,532.00	3.04
74	000333	美的集团	20,897,349.70	3.01
75	002511	中顺洁柔	20,786,913.28	2.99
76	300724	捷佳伟创	20,684,460.89	2.98
77	000998	隆平高科	20,634,332.14	2.97
78	601952	苏垦农发	20,620,549.16	2.97
79	000100	TCL 科技	19,263,065.36	2.77
80	002594	比亚迪	18,867,785.83	2.72
81	603596	伯特利	18,821,182.98	2.71
82	300759	康龙化成	18,785,158.80	2.70
83	300709	精研科技	18,691,497.95	2.69
84	002049	紫光国微	18,492,138.30	2.66
85	603160	汇顶科技	18,150,638.94	2.61
86	603866	桃李面包	17,995,229.18	2.59
87	002851	麦格米特	17,337,024.71	2.50
88	600028	中国石化	16,992,093.00	2.45
89	600104	上汽集团	16,845,214.42	2.42
90	002041	登海种业	16,581,473.33	2.39
91	601088	中国神华	16,278,684.39	2.34
92	688029	南微医学	16,208,555.42	2.33
93	603806	福斯特	15,840,574.81	2.28
94	600161	天坛生物	15,011,661.21	2.16
95	300792	壹网壹创	14,667,120.49	2.11
96	600031	三一重工	13,976,781.17	2.01
97	603517	绝味食品	13,926,671.00	2.00

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,463,595,793.64
卖出股票收入（成交）总额	4,513,390,454.98

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	430,777,752.90	4.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	127,177,046.40	1.23
	其中：政策性金融债	127,177,046.40	1.23
4	企业债券	3,941,196,000.00	38.05
5	企业短期融资券	159,323,000.00	1.54
6	中期票据	4,441,788,000.00	42.88
7	可转债（可交换债）	1,056,306,447.72	10.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,156,568,247.02	98.05

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20 国债 01	3,824,130	382,374,758.70	3.69
2	163903	20 海通 08	3,000,000	300,360,000.00	2.90
3	113011	光大转债	2,259,990	279,967,561.20	2.70
4	163925	20 招证 G3	2,400,000	240,120,000.00	2.32
5	163495	20 一汽 01	2,100,000	205,527,000.00	1.98

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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包括 20 海通 08（证券代码：163903）。

根据市场交易商协会官网披露，因在永煤控股调查时发现海通证券及相关子公司或存在操纵市场等涉嫌扰乱市场秩序的恶劣行为，交易商协会对海通证券及其相关子公司启动自律调查。

上述处罚信息公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和分析，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.11.2 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。

8.11.3 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	1,826,432.99
2	应收证券清算款	118,546,284.73
3	应收股利	-
4	应收利息	144,068,953.96
5	应收申购款	35,010,778.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	299,452,449.88

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	279,967,561.20	2.70
2	127005	长证转债	64,428,045.00	0.62
3	128028	赣锋转债	37,343,472.07	0.36
4	128048	张行转债	36,712,166.40	0.35
5	128095	恩捷转债	35,188,817.16	0.34

6	128114	正邦转债	23,130,481.01	0.22
7	128029	太阳转债	23,031,319.50	0.22
8	113545	金能转债	21,947,387.60	0.21
9	113583	益丰转债	21,631,460.50	0.21
10	123044	红相转债	21,058,564.87	0.20
11	127011	中鼎转 2	19,248,218.50	0.19
12	113582	火炬转债	18,972,374.00	0.18
13	128105	长集转债	17,300,849.49	0.17
14	113537	文灿转债	13,728,855.20	0.13
15	110051	中天转债	9,412,805.60	0.09
16	113508	新凤转债	5,574,165.00	0.05

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,640	5,439,397.11	8,903,059,805.79	99.80%	17,551,462.45	0.20%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	394,258.47	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016年4月1日 ）基金份额总额	200,141,408.40
本报告期期初基金份额总额	632,486,128.21
本报告期基金总申购份额	12,602,157,099.76
减:本报告期基金总赎回份额	4,314,031,959.73
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	8,920,611,268.24

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬共计人民币 100,000.00 元。目前的审计机构已连续 5 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	2	5,465,553,539.52	55.05%	5,090,068.62	60.93%	-
东北证券股	3	4,463,150,645.27	44.95%	3,263,908.57	39.07%	新增 3 个

份有限公司						交易单元
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元

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。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券股份有限公司	4,980,690,876.16	49.13%	67,086,300,000.00	25.01%	-	-
东北证券股份有限公司	5,156,337,876.96	50.87%	201,167,200,000.00	74.99%	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华远景债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 8 日
2	《银华远景债券型证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 8 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于银华远景债券型证券投资基金增聘基金经理的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 8 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 1 月 18 日
5	《银华远景债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 18 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于增加浙江同花顺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》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 21 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海浦东发展银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 2 月 10 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于调整银华远景债券型证券投资基金定期定额投资的最低金额的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 2 月 28 日

9	《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》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月5日
10	《银华远景债券型证券投资基金托管协议（2020年3月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月18日
11	《银华远景债券型证券投资基金基金合同（2020年3月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月18日
12	《银华远景债券型证券投资基金更新招募说明书（2020年第2号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月18日
13	《银华远景债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年第2号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月18日
14	《银华基金管理股份有限公司关于根据<公开募集证券投资基金信息披露管理办法>修改旗下15只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月18日
15	《银华基金管理股份有限公司关于基金经理暂停履行职务的公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月20日
16	《银华基金管理股份有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月24日

17	《银华基金管理股份有限公司关于增加中国人寿保险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》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 28 日
18	《银华基金管理股份有限公司关于增加兴业银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 15 日
19	《银华远景债券型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 16 日
20	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 4 月 18 日
21	《银华远景债券型证券投资基金 2019 年年度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 18 日
22	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 4 月 22 日
23	《银华远景债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
24	《银华远景债券型证券投资基金分红公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 4 月 27 日
25	《银华远景债券型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额投资	证券时报、中国证监会基金电子披露网	2020 年 4 月 29 日

	及转换转入）业务的公告》	站及本基金管理人网站	
26	《银华远景债券型证券投资基金更新招募说明书（2020年第3号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年5月8日
27	《银华远景债券型证券投资基金更新招募说明书摘要（2020年第3号）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年5月8日
28	《银华基金管理股份有限公司关于增加长城证券股份有限公司为银华远景债券型证券投资基金代销机构的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年6月9日
29	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海基煜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》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年6月9日
30	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为代销机构的公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年7月1日
31	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2020年第2季度报告提示性公告》	四大证券报	2020年7月18日
32	《银华远景债券型证券投资基金2020年第2季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年7月18日
33	《银华基金管理股份有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年8月5日

34	《银华基金管理股份有限公司关于增加和耕传承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》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 8 月 13 日
35	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 8 月 28 日
36	《银华远景债券型证券投资基金 2020 年中期报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 8 月 28 日
37	《银华远景债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 9 月 1 日
38	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 10 月 27 日
39	《银华远景债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 10 月 27 日
40	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为代销机构的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 10 月 30 日
41	《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》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 11 月 5 日
42	《银华基金管理股份有限公司关于银华远景债券型证券投资基金增加中国民生银行股份有限公司	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人	2020 年 11 月 10 日

	为代销机构的公告》	网站	
43	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为代销机构的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 11 月 19 日
44	《银华远景债券型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 11 月 25 日
45	《银华远景债券型证券投资基金分红公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 12 月 4 日
46	《银华基金管理股份有限公司关于增加喜鹊财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》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 12 月 8 日
47	《银华远景债券型证券投资基金恢复大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告》	证券时报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 12 月 8 日
48	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中国国际金融股份有限公司为代销机构的公告》	三大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 12 月 23 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/01/01-2020/01/19	217,376,067.33	313,918,983.10	199,999,999.99	331,295,050.44	3.71%
产品特有风险							
投资人在投资本基金时，将面临本基金的特有风险，具体包括： 1）当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权； 2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会； 3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额； 4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动； 5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2020 年 3 月 18 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于根据<公开募集证券投资基金信息披露管理办法>修改旗下 15 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》，对本基金基金合同、托管协议、招募说明书及摘要信息披露有关条款进行了修改。相关法律文件的修改自本公告发布之日起生效。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会准予银华远景债券型证券投资基金募集注册的文件

13.1.2《银华远景债券型证券投资基金招募说明书》

13.1.3《银华远景债券型证券投资基金基金合同》

13.1.4《银华远景债券型证券投资基金托管协议》

13.1.5《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2021 年 3 月 29 日