

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 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 2020 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.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	62
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.....	62
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.....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	65
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	65
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73

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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§12 备查文件目录.....	74
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	银华稳健增利灵活配置混合发起式	
基金主代码	005260	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 15 日	
基金管理人	银华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	476,520,501.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
下属分级基金的交易代码:	005260	005261
报告期末下属分级基金的份额总额	475,843,686.63 份	676,815.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金灵活运用多种投资策略,在严格控制投资组合风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳健增值。	
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权益类资产、债券类资产和现金等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。本基金在股票投资过程中,运用量化模型和多种量化选股策略进行信息采集和处理,从而提高对于上市公司盈利变化、成长性变化、特殊事件等投资信息利用的效率,提高投资收益率。本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,动态调整组合久期和债券的结构,并通过自下而上精选债券,获取优化收益。本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%,权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金。	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	银华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010) 58163000	(010) 66105799
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4006783333, (010) 85186558	95588	
传真	(010) 58163027	(010) 66105798	
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	100738	100140	
法定代表人	王珠林	陈四清	

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

基金级别	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	59,544,508.00	121,702.93
本期利润	90,883,169.70	192,190.90
加权平均基金份额本期利润	0.1911	0.2185
本期加权平均净值利润率	18.52%	21.38%
本期基金份额净值增长率	19.74%	19.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	10,801,019.49	10,623.35
期末可供分配基金份额利润	0.0227	0.0157
期末基金资产净值	551,955,155.10	779,802.49
期末基金份额净值	1.1600	1.1522
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	16.00%	15.22%

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

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

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	11.36%	0.84%	3.35%	0.43%	8.01%	0.41%
过去三个月	20.44%	1.01%	5.84%	0.47%	14.60%	0.54%
过去六个月	19.74%	1.63%	2.79%	0.75%	16.95%	0.88%
过去一年	36.58%	1.28%	7.20%	0.61%	29.38%	0.67%
自基金合同生效起至今	16.00%	1.18%	6.10%	0.66%	9.90%	0.52%

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

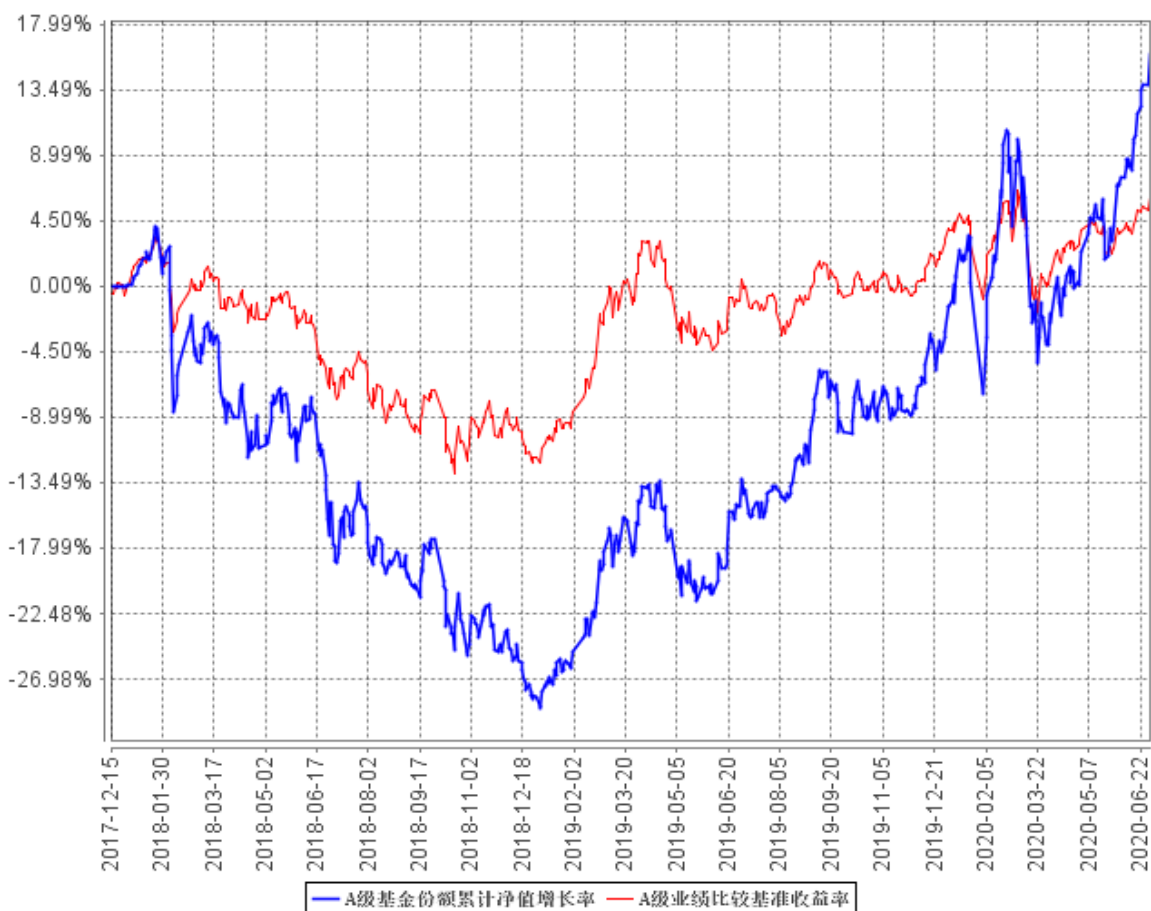
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	11.31%	0.84%	3.35%	0.43%	7.96%	0.41%
过去三个月	20.35%	1.01%	5.84%	0.47%	14.51%	0.54%
过去六个月	19.54%	1.63%	2.79%	0.75%	16.75%	0.88%
过去一年	36.16%	1.28%	7.20%	0.61%	28.96%	0.67%
自基金合同生效起至今	15.22%	1.18%	6.10%	0.66%	9.12%	0.52%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*50%+中国债券总指数收益率*50%。

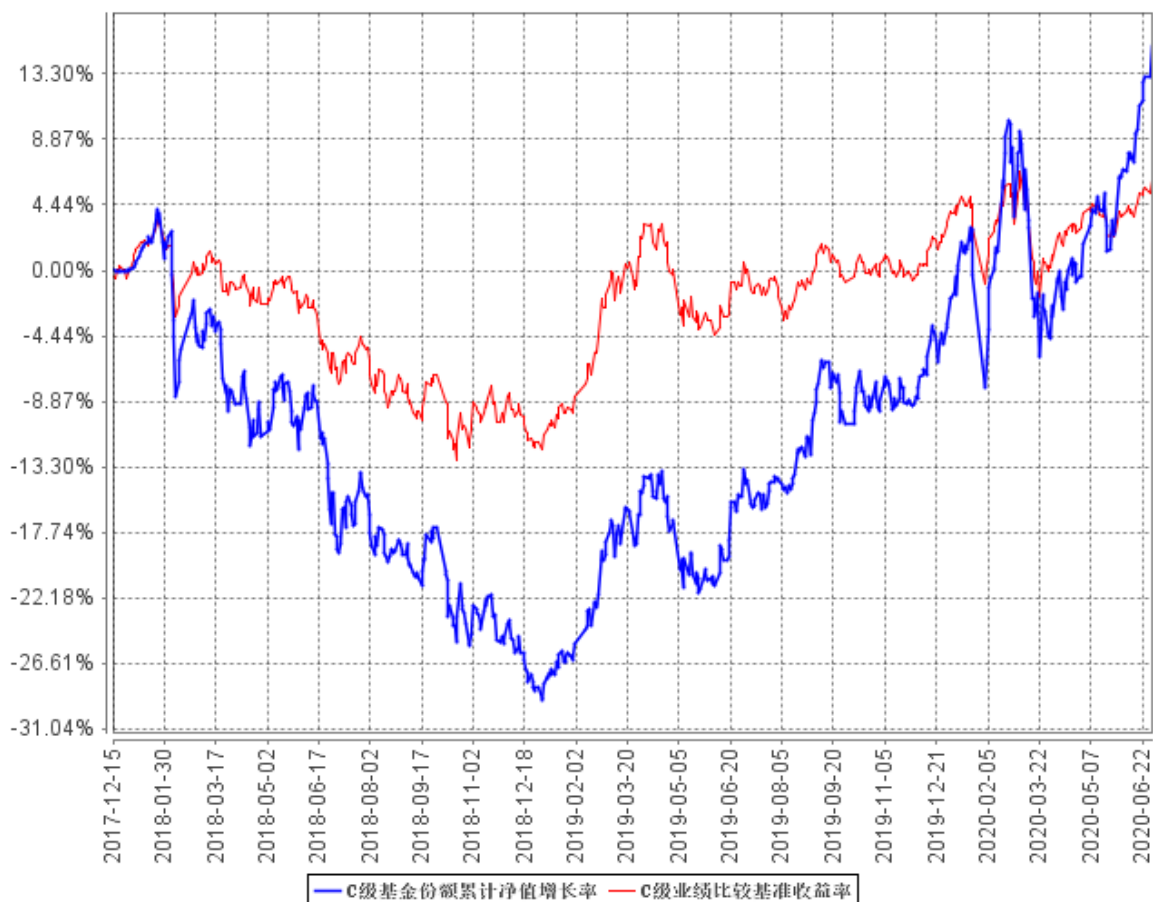
本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 0%–95% 的股票资产，其余资产主要投资于权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具。因此，“中证 800 指数收益率*50%+中国债券总指数收益率*50%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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

A 级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



C级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：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、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%，山西海鑫实业股份有限公司 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 6 月 30 日，本基金管理人管理着 130 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 指数分级证券投资基金、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 指数分级证券投资基金、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、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、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)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、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、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、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、银华双月定期理财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、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、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、银华安享短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券

投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊享养老目标日期 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。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		
马君女士	本基金的基金经理	2017 年 12 月 15 日	-	11.5 年	硕士学位。2008 年 7 月至 2009 年 3 月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自 2012 年 9 月 4 日起担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013 年 12 月 16 日至 2015 年 7 月 16 日兼任银华消费主题分级股票型证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 6 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证国防安全指数分级证

					券投资基金基金经理，2015年8月13日至2016年8月5日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日起兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理。自2017年9月15日起兼任银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2017年11月9日起兼任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基金经理，自2017年12月15日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018年5月11日起兼任银华中市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年1月22日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年3月20日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年5月28日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
杨腾先生	本基金的基金经理助理	2017年12月15日	-	7.5年	硕士学位，曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司，2015年加入银华基金，历任量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

谭跃峰先生	本基金的基金经理助理	2020年1月10日	-	8.5年	学士学位，曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012年8月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员，现任基金经理助理。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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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、《银华稳健增利灵活配置混合型发起式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

在报告期内，我们积极改进自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件。除此之外运用自行开发的量化投资模型，精选细分子行业个股，力争实现超越基准的阿尔法收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 基金份额净值为 1.1600 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.74%；截至本报告期末银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额净值为 1.1522 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.54%；同期业绩比较基准收益率为 2.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年中，新冠疫情的扩散改变了全球经济、市场的原有格局。国内方面，通过完善的联防联控与严格的检测治疗措施，已经使疫情得到了有效的控制，二季度中已经进入有序复工复产，主要经济数据也已经显著反弹。而国外方面，疫情仍然在大规模的扩散过程中。在国内疫情控制与经济恢复的背景下，A 股市场在经历了一季度震荡之后，形成了一轮结构性反弹行情，创业板、中小板领涨主要指数。行业层面，医药、餐饮旅游、食品饮料等行业表现领先，石油石化、煤炭、银行等行业表现落后。

展望下半年我们认为，疫情的发展与控制仍将是全球市场的核心变量，也将反过来影响 A 股市场的情绪与资金流向。目前，在国内疫情控制得力的背景下，下半年复工复产进程可期，A 股市场也将持续出现机会。我们需要关注的风险点在于，全球疫情的扩散带来的国际摩擦等黑天鹅事件。在此过程中，我们持续看好龙头类公司的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员

和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

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

4.7 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

本报告期内，本基金托管人在对银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的相关规定，不存在任何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，银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算，基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实，准确和完整。

§ 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：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	66,046,380.84	23,981,280.87
结算备付金		17,995,764.64	10,495,050.78
存出保证金		6,111,827.10	174,815.65
交易性金融资产	6.4.7.2	464,180,055.13	429,685,726.89
其中：股票投资		463,178,555.13	429,685,726.89
基金投资		-	-
债券投资		1,001,500.00	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	39,561.27	11,177.63
应收股利		-	-
应收申购款		58,450.83	10,252.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		554,432,039.81	464,358,304.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	78.75
应付赎回款		90,925.33	32,762.56
应付管理人报酬		257,536.99	229,340.66
应付托管费		64,384.24	57,335.19
应付销售服务费		224.40	544.17
应付交易费用	6.4.7.7	1,120,276.08	1,626,386.42
应交税费		81,462.06	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,273.12	45,002.27
负债合计		1,697,082.22	1,991,450.02
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	476,520,501.95	477,247,703.07
未分配利润	6.4.7.10	76,214,455.64	-14,880,848.39
所有者权益合计		552,734,957.59	462,366,854.68
负债和所有者权益总计		554,432,039.81	464,358,304.70

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 基金份额净值 1.1600 元，基金份额总额 475,843,686.63 份；银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额净值 1.1522 元，基金份额总额 676,815.32 份。银华稳健增利灵活配置混合发起式份额总额合计为 476,520,501.95 份。

6.2 利润表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		98,380,848.67	1,853,043.21
1.利息收入		260,760.87	15,571.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	244,888.54	8,945.20
债券利息收入		15,872.33	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	6,626.54
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		66,707,611.87	983,633.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	59,066,113.23	913,997.31
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	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	4,191,842.72	-
股利收益	6.4.7.16	3,449,655.92	69,635.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	31,409,149.67	832,132.03
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	3,326.26	21,706.22
减：二、费用		7,305,488.07	161,042.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,465,978.28	50,873.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	366,494.51	7,631.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,577.58	1,980.21
4. 交易费用	6.4.7.19	5,373,367.83	67,054.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		15,090.63	-
7. 其他费用	6.4.7.20	82,979.24	33,502.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		91,075,360.60	1,692,000.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		91,075,360.60	1,692,000.96

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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）	477,247,703.07	-14,880,848.39	462,366,854.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	91,075,360.60	91,075,360.60
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）	-727,201.12	19,943.43	-707,257.69
其中：1.基金申购款	2,197,630.96	99,253.52	2,296,884.48
2.基金赎回款	-2,924,832.08	-79,310.09	-3,004,142.17
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）	476,520,501.95	76,214,455.64	552,734,957.59
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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）	13,061,171.16	-3,678,627.50	9,382,543.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,692,000.96	1,692,000.96
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）	-277,128.86	54,586.99	-222,541.87
其中：1.基金申购款	1,317,798.67	-225,768.16	1,092,030.51
2.基金赎回款	-1,594,927.53	280,355.15	-1,314,572.38
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）	12,784,042.30	-1,932,039.55	10,852,002.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新
凌宇翔
伍军辉

基金管理人负责人
主管会计工作负责人
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]857号《关于准予银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于2017年11月13日至2017年12月8日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙

伙)验证出具安永华明(2017)验字第 60468687_A28 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017 年 12 月 15 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 12,087,867.63 元,折合 12,087,867.63 份银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 类基金份额;有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 1,722.16 元,折合 1,722.16 份银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币 12,089,589.79 元,折合 12,089,589.79 份银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 类基金份额。银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 类基金份额已收到的有效净认购金额为人民币 1,086,079.88 元,折合 1,086,079.88 份银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 类基金份额;有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 235.60 元,折合 235.60 份银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币 1,086,315.48 元,折合 1,086,315.48 份银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 类基金份额。银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 类基金份额和银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 类基金份额收到的实收基金合计人民币 13,175,905.27 元,合计折合 13,175,905.27 份银华稳健增利灵活配置混合发起式基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据所收取的认购费用、申购费用、销售服务费用方式的差异,将基金份额分为 A 类和 C 类不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

本基金依法投资于国内发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具(含同业存单)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)。本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%,权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。业绩比较基准:中证 800 指数收益率 \times 50%+中国债券总指数收益率 \times 50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税

额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	66,046,380.84
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:	66,046,380.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	416,861,000.68	463,178,555.13	46,317,554.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,008,100.00	-6,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,008,100.00	-6,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	417,869,100.68	464,180,055.13	46,310,954.45

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	46,395,200.00	-	-	
股指期货投资	46,395,200.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	46,395,200.00	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于 2020 年 6 月 30 日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为：IC2007 买入股指期货持仓量 40 手，合约市值人民币 46,395,200.00 元，公允价值变动人民币 1,416,720.00 元。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	6,504.78
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,084.40
应收债券利息	31,935.89
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	36.20
合计	39,561.27

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,120,276.08
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,120,276.08

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	223.88
应付证券出借违约金	-

预提费用	82,049.24
合计	82,273.12

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	475,423,736.19	475,423,736.19
本期申购	1,404,166.30	1,404,166.30
本期赎回(以“-”号填列)	-984,215.86	-984,215.86
- 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	475,843,686.63	475,843,686.63

金额单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,823,966.88	1,823,966.88
本期申购	793,464.66	793,464.66
本期赎回(以“-”号填列)	-1,940,616.22	-1,940,616.22
- 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	676,815.32	676,815.32

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

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-48,765,272.18	33,950,219.16	-14,815,053.02
本期利润	59,544,508.00	31,338,661.70	90,883,169.70

本期基金份额交易产生的变动数	21,783.67	21,568.12	43,351.79
其中：基金申购款	-13,278.25	90,442.57	77,164.32
基金赎回款	35,061.92	-68,874.45	-33,812.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,801,019.49	65,310,448.98	76,111,468.47

单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-195,448.75	129,653.38	-65,795.37
本期利润	121,702.93	70,487.97	192,190.90
本期基金份额交易产生的变动数	84,369.17	-107,777.53	-23,408.36
其中：基金申购款	-23,601.40	45,690.60	22,089.20
基金赎回款	107,970.57	-153,468.13	-45,497.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,623.35	92,363.82	102,987.17

6.4.7.11 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6月30日
活期存款利息收入	145,362.03
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	98,498.04
其他	1,028.47
合计	244,888.54

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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6月30日
卖出股票成交总额	1,943,906,711.50
减：卖出股票成本总额	1,884,840,598.27
买卖股票差价收入	59,066,113.23

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	4,317,598.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,449,655.92
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	3,449,655.92

6.4.7.17 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6月30日
1. 交易性金融资产	29,992,429.67
——股票投资	29,999,029.67
——债券投资	-6,600.00

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1,416,720.00
——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	31,409,149.67

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	3,281.21
转换费收入 005260	45.05
合计	3,326.26

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	5,373,367.83
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	5,373,367.83

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

银行费用	930.00
合计	82,979.24

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,465,978.28	50,873.89
其中：支付销售机构的客户维护费	3,108.31	5,905.15

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	366,494.51	7,631.10

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	合计
中国工商银行	-	462.07	462.07
银华基金管理股份有限公司	-	28.45	28.45
合计	-	490.52	490.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	14.42	14.42
中国工商银行	-	1,043.41	1,043.41
合计	-	1,057.83	1,057.83

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。

其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期初持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.10%	-

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	10,001,400.14	-

报告期初持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	91.02%	-

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	66,046,380.84	145,362.03	2,831,992.80	8,053.48

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

无。

6.4.12 期末（2020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
601816	京沪	2020年	2020	新发	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-

	高铁	1月8日	年7月16日	流通受限						
688186	广大特材	2020年1月23日	2020年8月11日	新发流通受限	17.16	34.15	8,033	137,846.28	274,326.95	-
688004	博汇科技	2020年6月5日	2020年12月12日	新发流通受限	28.77	71.90	2,500	71,925.00	179,750.00	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝	2020年	2020	新股	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-

	股份	6月23日	年7月2日	流通受限						
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002254	泰和新材	2020年6月29日	重大事项	13.60	2020年7月14日	14.96	31,742	416,891.29	431,691.20	-
300084	海默科技	2020年6月29日	重大事项	3.88	2020年7月6日	4.25	25,857	100,586.73	100,325.16	-

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

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；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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	66,046,380.84	-	-	-	-	-	66,046,380.84
结算备付金	17,995,764.64	-	-	-	-	-	17,995,764.64
存出保证金	80,451.10	-	-	-	-	6,031,376.00	6,111,827.10
交易性金融资产	-	1,001,500.00	-	-	-	463,178,555.13	464,180,055.13
应收利息	-	-	-	-	-	39,561.27	39,561.27
应收申购款	-	-	-	-	-	58,450.83	58,450.83
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	84,122,596.58	1,001,500.00	-	-	-	469,307,943.23	554,432,039.81
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,416,720.00	1,416,720.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	90,925.33	90,925.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	257,536.99	257,536.99
应付托管费	-	-	-	-	-	64,384.24	64,384.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	224.40	224.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,120,276.08	1,120,276.08
应交税费	-	-	-	-	-	81,462.06	81,462.06
其他负债	-	-	-	-	-	-1,334,446.88	-1,334,446.88

负债总计	-	-	-	-	-	1,697,082.22	1,697,082.22
利率敏感度缺口	84,122,596.58	1,001,500.00	-	-	-	-467,610,861.01	552,734,957.59
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	23,981,280.87	-	-	-	-	-	23,981,280.87
结算备付金	10,495,050.78	-	-	-	-	-	10,495,050.78
存出保证金	174,815.65	-	-	-	-	-	174,815.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-429,685,726.89	429,685,726.89
应收利息	-	-	-	-	-	11,177.63	11,177.63
应收申购款	-	-	-	-	-	10,252.88	10,252.88
资产总计	34,651,147.30	-	-	-	-	-429,707,157.40	464,358,304.70
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	78.75	78.75
应付赎回款	-	-	-	-	-	32,762.56	32,762.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	229,340.66	229,340.66
应付托管费	-	-	-	-	-	57,335.19	57,335.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	544.17	544.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,626,386.42	1,626,386.42
其他负债	-	-	-	-	-	45,002.27	45,002.27
负债总计	-	-	-	-	-	1,991,450.02	1,991,450.02
利率敏感度缺口	34,651,147.30	-	-	-	-	-427,715,707.38	462,366,854.68

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 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要

求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30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	463,178,555.13	83.80	429,685,726.89	92.93
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,001,500.00	0.18	-	-
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	464,180,055.13	83.98	429,685,726.89	92.93

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变； 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了 基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析		本期末（2020年6月 30日）	上年度末（2019年12月 31日）
	业绩比较基准上升 5%	54,113,694.40	33,400,477.49
	业绩比较基准下降 5%	-54,113,694.40	-33,400,477.49

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	463,178,555.13	83.54
	其中：股票	463,178,555.13	83.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,001,500.00	0.18
	其中：债券	1,001,500.00	0.18
	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	84,042,145.48	15.16
8	其他各项资产	6,209,839.20	1.12
9	合计	554,432,039.81	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	4,273,727.40	0.77
B	采矿业	6,988,042.69	1.26
C	制造业	294,877,617.40	53.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,099,220.14	0.92
E	建筑业	4,246,367.64	0.77
F	批发和零售业	14,922,444.98	2.70
G	交通运输、仓储和邮政业	13,871,986.97	2.51
H	住宿和餐饮业	852,673.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,613,599.60	11.69
J	金融业	16,787,057.18	3.04
K	房地产业	11,476,742.18	2.08
L	租赁和商务服务业	2,659,129.23	0.48
M	科学研究和技术服务业	8,655,159.32	1.57

N	水利、环境和公共设施管理业	4,320,021.59	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,870,864.19	1.06
R	文化、体育和娱乐业	2,465,343.42	0.45
S	综合	1,198,558.20	0.22
	合计	463,178,555.13	83.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603444	吉比特	16,427	9,018,587.27	1.63
2	600519	贵州茅台	6,007	8,787,520.16	1.59
3	000858	五粮液	41,269	7,061,951.28	1.28
4	300770	新媒股份	31,378	7,018,003.48	1.27
5	002821	凯莱英	27,151	6,597,693.00	1.19
6	300315	掌趣科技	852,747	6,250,635.51	1.13
7	603986	兆易创新	25,126	5,927,474.66	1.07
8	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	1.01
9	002371	北方华创	31,835	5,440,919.85	0.98
10	300782	卓胜微	12,121	4,918,338.17	0.89
11	600426	华鲁恒升	268,045	4,739,035.60	0.86
12	002555	三七互娱	97,421	4,559,302.80	0.82
13	300014	亿纬锂能	89,169	4,266,736.65	0.77
14	002439	启明星辰	100,386	4,223,239.02	0.76
15	000661	长春高新	9,540	4,152,762.00	0.75
16	300253	卫宁健康	175,159	4,018,147.46	0.73
17	601799	星宇股份	30,038	3,814,826.00	0.69
18	300724	捷佳伟创	42,229	3,738,533.37	0.68
19	600845	宝信软件	61,715	3,646,122.20	0.66
20	601658	邮储银行	796,578	3,640,361.46	0.66
21	000623	吉林敖东	222,982	3,507,506.86	0.63
22	600161	天坛生物	76,550	3,470,011.50	0.63
23	603605	珀莱雅	18,730	3,371,774.60	0.61

24	600872	中炬高新	57,056	3,339,487.68	0.60
25	300601	康泰生物	20,300	3,291,848.00	0.60
26	002475	立讯精密	63,618	3,266,784.30	0.59
27	000503	国新健康	262,725	2,926,756.50	0.53
28	600755	厦门国贸	436,582	2,881,441.20	0.52
29	002078	太阳纸业	297,069	2,828,096.88	0.51
30	300598	诚迈科技	14,527	2,751,413.80	0.50
31	603259	药明康德	28,182	2,722,381.20	0.49
32	600570	恒生电子	24,828	2,673,975.60	0.48
33	600276	恒瑞医药	28,918	2,669,131.40	0.48
34	603288	海天味业	20,984	2,610,409.60	0.47
35	601318	中国平安	35,036	2,501,570.40	0.45
36	603517	绝味食品	34,988	2,475,051.12	0.45
37	300760	迈瑞医疗	7,996	2,444,377.20	0.44
38	603588	高能环境	200,100	2,333,166.00	0.42
39	300832	新产业	13,500	2,324,565.00	0.42
40	002375	亚厦股份	227,100	2,320,962.00	0.42
41	603345	安井食品	19,392	2,288,256.00	0.41
42	600466	蓝光发展	420,800	2,268,112.00	0.41
43	300078	思创医惠	166,175	2,248,347.75	0.41
44	688086	紫晶存储	32,751	2,220,190.29	0.40
45	300661	圣邦股份	7,033	2,145,416.65	0.39
46	603882	金域医学	23,700	2,121,150.00	0.38
47	300725	药石科技	16,975	2,109,143.75	0.38
48	601100	恒立液压	25,823	2,071,004.60	0.37
49	300188	美亚柏科	102,917	2,040,844.11	0.37
50	300548	博创科技	33,926	2,028,774.80	0.37
51	000568	泸州老窖	22,032	2,007,555.84	0.36
52	002518	科士达	155,055	1,922,682.00	0.35
53	601677	明泰铝业	217,231	1,885,565.08	0.34
54	002798	帝欧家居	58,012	1,883,649.64	0.34
55	600027	华电国际	549,328	1,878,701.76	0.34
56	002212	南洋股份	70,395	1,871,099.10	0.34
57	688363	华熙生物	12,489	1,847,123.10	0.33
58	002242	九阳股份	49,381	1,840,429.87	0.33
59	002007	华兰生物	36,457	1,826,860.27	0.33
60	002396	星网锐捷	50,388	1,780,208.04	0.32
61	300009	安科生物	98,846	1,769,343.40	0.32
62	002465	海格通信	135,037	1,747,378.78	0.32

63	300347	泰格医药	17,131	1,745,306.28	0.32
64	601128	常熟银行	232,356	1,744,993.56	0.32
65	603127	昭衍新药	16,568	1,741,793.84	0.32
66	002920	德赛西威	28,337	1,737,908.21	0.31
67	600887	伊利股份	55,136	1,716,383.68	0.31
68	002643	万润股份	99,893	1,715,162.81	0.31
69	600058	五矿发展	275,493	1,663,977.72	0.30
70	300037	新宙邦	29,425	1,620,140.50	0.29
71	600884	杉杉股份	134,300	1,583,397.00	0.29
72	601688	华泰证券	83,844	1,576,267.20	0.29
73	000977	浪潮信息	39,055	1,530,174.90	0.28
74	600031	三一重工	81,003	1,519,616.28	0.27
75	300502	新易盛	23,988	1,514,122.56	0.27
76	300072	三聚环保	352,142	1,507,167.76	0.27
77	300326	凯利泰	51,702	1,504,528.20	0.27
78	600048	保利地产	101,404	1,498,751.12	0.27
79	300577	开润股份	55,285	1,491,036.45	0.27
80	603609	禾丰牧业	99,635	1,484,561.50	0.27
81	002459	晶澳科技	77,206	1,449,928.68	0.26
82	600438	通威股份	82,420	1,432,459.60	0.26
83	300308	中际旭创	22,616	1,424,808.00	0.26
84	002511	中顺洁柔	63,711	1,420,755.30	0.26
85	300073	当升科技	42,240	1,396,876.80	0.25
86	000063	中兴通讯	34,678	1,391,628.14	0.25
87	600707	彩虹股份	302,400	1,378,944.00	0.25
88	600195	中牧股份	84,899	1,377,910.77	0.25
89	688111	金山办公	4,025	1,374,859.50	0.25
90	600763	通策医疗	8,218	1,370,515.86	0.25
91	600585	海螺水泥	25,885	1,369,575.35	0.25
92	002714	牧原股份	16,651	1,365,382.00	0.25
93	000513	丽珠集团	28,405	1,363,724.05	0.25
94	300357	我武生物	21,852	1,360,287.00	0.25
95	002138	顺络电子	54,107	1,349,969.65	0.24
96	000002	万科 A	51,046	1,334,342.44	0.24
97	300183	东软载波	84,601	1,327,389.69	0.24
98	601168	西部矿业	228,600	1,325,880.00	0.24
99	002557	洽洽食品	24,012	1,301,210.28	0.24
100	000898	鞍钢股份	530,555	1,299,859.75	0.24
101	603658	安图生物	8,000	1,299,520.00	0.24

102	600862	中航高科	76,552	1,295,259.84	0.23
103	300759	康龙化成	12,987	1,277,920.80	0.23
104	600201	生物股份	45,689	1,271,981.76	0.23
105	300122	智飞生物	12,631	1,264,994.65	0.23
106	300750	宁德时代	7,208	1,256,786.88	0.23
107	002867	周大生	56,332	1,248,880.44	0.23
108	002531	天顺风能	207,986	1,243,756.28	0.23
109	000951	中国重汽	39,465	1,233,675.90	0.22
110	688166	博瑞医药	19,894	1,231,239.66	0.22
111	600600	青岛啤酒	15,900	1,216,350.00	0.22
112	600867	通化东宝	69,527	1,211,855.61	0.22
113	603338	浙江鼎力	15,923	1,206,485.71	0.22
114	300462	华铭智能	53,048	1,203,128.64	0.22
115	300676	华大基因	7,700	1,200,507.00	0.22
116	603019	中科曙光	30,993	1,190,131.20	0.22
117	000625	长安汽车	107,148	1,178,628.00	0.21
118	002546	新联电子	297,900	1,170,747.00	0.21
119	603898	好莱客	82,114	1,166,839.94	0.21
120	300482	万孚生物	11,138	1,158,352.00	0.21
121	002127	南极电商	54,671	1,157,385.07	0.21
122	002648	卫星石化	70,800	1,151,916.00	0.21
123	603203	快克股份	39,515	1,133,685.35	0.21
124	300529	健帆生物	16,293	1,132,363.50	0.20
125	600486	扬农化工	13,714	1,131,405.00	0.20
126	600809	山西汾酒	7,773	1,127,085.00	0.20
127	603786	科博达	14,900	1,122,715.00	0.20
128	300136	信维通信	20,933	1,109,867.66	0.20
129	603233	大参林	13,620	1,106,216.40	0.20
130	601233	桐昆股份	86,563	1,104,543.88	0.20
131	000708	中信特钢	64,082	1,095,161.38	0.20
132	600770	综艺股份	227,623	1,092,590.40	0.20
133	300558	贝达药业	7,772	1,087,924.56	0.20
134	300761	立华股份	27,946	1,077,038.84	0.19
135	603690	至纯科技	25,701	1,063,507.38	0.19
136	300395	菲利华	32,226	1,059,268.62	0.19
137	600298	安琪酵母	21,300	1,053,924.00	0.19
138	603866	桃李面包	20,706	1,053,728.34	0.19
139	000517	荣安地产	419,670	1,028,191.50	0.19
140	603018	中设集团	103,780	1,009,779.40	0.18

141	300674	宇信科技	23,384	1,009,019.60	0.18
142	000860	顺鑫农业	17,500	997,150.00	0.18
143	600309	万华化学	19,874	993,501.26	0.18
144	000895	双汇发展	21,203	977,246.27	0.18
145	300316	晶盛机电	39,494	977,081.56	0.18
146	300433	蓝思科技	34,613	970,548.52	0.18
147	603556	海兴电力	66,700	963,148.00	0.17
148	603708	家家悦	19,432	957,220.32	0.17
149	002410	广联达	13,556	944,853.20	0.17
150	600185	格力地产	80,558	935,278.38	0.17
151	300114	中航电测	81,300	927,633.00	0.17
152	601111	中国国航	137,458	908,597.38	0.16
153	600017	日照港	356,995	888,917.55	0.16
154	002233	塔牌集团	73,849	888,403.47	0.16
155	600562	国睿科技	59,651	884,027.82	0.16
156	300373	扬杰科技	26,300	881,576.00	0.16
157	600325	华发股份	124,381	878,129.86	0.16
158	300474	景嘉微	12,893	867,698.90	0.16
159	002384	东山精密	28,742	860,822.90	0.16
160	603939	益丰药房	9,459	860,769.00	0.16
161	300327	中颖电子	26,511	858,956.40	0.16
162	000705	浙江震元	120,000	855,600.00	0.15
163	300016	北陆药业	70,283	854,641.28	0.15
164	002422	科伦药业	39,600	831,600.00	0.15
165	000338	潍柴动力	59,549	817,012.28	0.15
166	600703	三安光电	32,591	814,775.00	0.15
167	002540	亚太科技	188,804	813,745.24	0.15
168	000825	太钢不锈	244,700	812,404.00	0.15
169	000333	美的集团	13,543	809,735.97	0.15
170	300059	东方财富	39,869	805,353.80	0.15
171	300498	温氏股份	36,845	803,221.00	0.15
172	600588	用友网络	18,102	798,298.20	0.14
173	600782	新钢股份	195,234	796,554.72	0.14
174	600009	上海机场	11,031	795,004.17	0.14
175	601601	中国太保	29,006	790,413.50	0.14
176	601666	平煤股份	208,558	780,006.92	0.14
177	002317	众生药业	45,425	779,493.00	0.14
178	688085	三友医疗	9,797	776,804.13	0.14
179	000807	云铝股份	177,965	775,927.40	0.14

180	603611	诺力股份	35,933	771,122.18	0.14
181	601021	春秋航空	21,862	770,416.88	0.14
182	601899	紫金矿业	174,828	769,243.20	0.14
183	600436	片仔癀	4,498	765,784.50	0.14
184	601231	环旭电子	34,761	759,180.24	0.14
185	300369	绿盟科技	32,591	759,044.39	0.14
186	601888	中国中免	4,912	756,595.36	0.14
187	000100	TCL 科技	121,512	753,374.40	0.14
188	601865	福莱特	39,843	749,048.40	0.14
189	603369	今世缘	18,721	744,908.59	0.13
190	603168	莎普爱思	95,802	739,591.44	0.13
191	603359	东珠生态	44,151	738,646.23	0.13
192	600362	江西铜业	54,665	735,790.90	0.13
193	600019	宝钢股份	160,337	731,136.72	0.13
194	002110	三钢闽光	109,399	728,597.34	0.13
195	603236	移远通信	3,500	728,000.00	0.13
196	601012	隆基股份	17,776	724,016.48	0.13
197	601028	玉龙股份	58,575	704,657.25	0.13
198	300036	超图软件	27,923	703,101.14	0.13
199	600900	长江电力	36,980	700,401.20	0.13
200	002352	顺丰控股	12,561	687,086.70	0.12
201	002460	赣锋锂业	12,759	683,499.63	0.12
202	300451	创业慧康	36,785	680,154.65	0.12
203	002025	航天电器	18,531	677,863.98	0.12
204	002812	恩捷股份	10,230	673,134.00	0.12
205	300545	联得装备	19,176	662,914.32	0.12
206	600346	恒力石化	46,954	657,356.00	0.12
207	000651	格力电器	11,609	656,721.13	0.12
208	002146	荣盛发展	80,100	648,810.00	0.12
209	002299	圣农发展	22,230	644,670.00	0.12
210	600988	赤峰黄金	53,867	641,017.30	0.12
211	000876	新希望	21,500	640,700.00	0.12
212	000596	古井贡酒	4,260	640,022.40	0.12
213	300015	爱尔眼科	14,589	633,892.05	0.11
214	002705	新宝股份	17,354	633,073.92	0.11
215	603737	三棵树	6,835	630,323.70	0.11
216	300685	艾德生物	8,176	629,224.96	0.11
217	603638	艾迪精密	12,000	628,800.00	0.11
218	002311	海大集团	13,180	627,236.20	0.11

219	601636	旗滨集团	104,973	621,440.16	0.11
220	600036	招商银行	18,176	612,894.72	0.11
221	600350	山东高速	99,500	610,930.00	0.11
222	603197	保隆科技	20,382	602,899.56	0.11
223	300284	苏交科	78,607	584,836.08	0.11
224	002597	金禾实业	25,400	583,438.00	0.11
225	002251	步步高	41,667	582,504.66	0.11
226	600118	中国卫星	18,880	582,070.40	0.11
227	300196	长海股份	54,356	575,086.48	0.10
228	000403	双林生物	7,700	570,801.00	0.10
229	600373	中文传媒	47,576	560,445.28	0.10
230	603993	洛阳钼业	152,202	558,581.34	0.10
231	300470	中密控股	17,700	557,550.00	0.10
232	600030	中信证券	23,078	556,410.58	0.10
233	300203	聚光科技	32,897	550,366.81	0.10
234	600053	九鼎投资	18,152	541,655.68	0.10
235	002380	科远智慧	38,600	540,400.00	0.10
236	300323	华灿光电	98,200	535,190.00	0.10
237	002791	坚朗五金	5,670	533,490.30	0.10
238	603881	数据港	4,899	529,434.93	0.10
239	300567	精测电子	7,726	527,299.50	0.10
240	300070	碧水源	64,500	523,740.00	0.09
241	603228	景旺电子	14,800	520,812.00	0.09
242	603579	荣泰健康	19,300	517,626.00	0.09
243	300383	光环新网	19,825	516,837.75	0.09
244	300003	乐普医疗	14,137	516,283.24	0.09
245	603883	老百姓	5,092	509,403.68	0.09
246	603678	火炬电子	18,049	505,732.98	0.09
247	002142	宁波银行	19,202	504,436.54	0.09
248	300633	开立医疗	12,663	502,087.95	0.09
249	000937	冀中能源	165,000	498,300.00	0.09
250	002293	罗莱生活	53,900	498,036.00	0.09
251	603801	志邦家居	18,654	497,875.26	0.09
252	002100	天康生物	30,624	493,046.40	0.09
253	600764	中国海防	19,346	489,453.80	0.09
254	601628	中国人寿	17,980	489,235.80	0.09
255	300709	精研科技	5,079	488,345.85	0.09
256	601668	中国建筑	102,064	486,845.28	0.09
257	600682	南京新百	47,900	485,706.00	0.09

258	600378	昊华科技	23,466	480,818.34	0.09
259	002727	一心堂	12,891	478,385.01	0.09
260	300533	冰川网络	12,814	463,610.52	0.08
261	300150	世纪瑞尔	106,161	462,861.96	0.08
262	300559	佳发教育	21,300	451,986.00	0.08
263	300630	普利制药	6,100	451,095.00	0.08
264	002793	罗欣药业	33,900	447,819.00	0.08
265	002624	完美世界	7,708	444,289.12	0.08
266	600258	首旅酒店	28,900	444,193.00	0.08
267	600176	中国巨石	48,118	440,279.70	0.08
268	300829	金丹科技	5,880	439,177.20	0.08
269	300144	宋城演艺	25,268	437,136.40	0.08
270	300083	劲胜智能	73,744	436,564.48	0.08
271	000926	福星股份	82,721	434,285.25	0.08
272	002747	埃斯顿	36,240	433,430.40	0.08
273	002254	泰和新材	31,742	431,691.20	0.08
274	002507	涪陵榨菜	11,988	431,687.88	0.08
275	000001	平安银行	33,659	430,835.20	0.08
276	002153	石基信息	11,029	430,461.87	0.08
277	300446	乐凯新材	46,152	424,598.40	0.08
278	000958	东方能源	101,601	422,660.16	0.08
279	603027	千禾味业	13,259	418,719.22	0.08
280	600674	川投能源	44,852	415,778.04	0.08
281	601166	兴业银行	26,244	414,130.32	0.07
282	300306	远方信息	45,281	413,415.53	0.07
283	601288	农业银行	121,295	409,977.10	0.07
284	600754	锦江酒店	14,720	408,480.00	0.07
285	300562	乐心医疗	18,638	408,358.58	0.07
286	600547	山东黄金	10,977	401,977.74	0.07
287	002120	韵达股份	16,405	401,102.25	0.07
288	300494	盛天网络	16,700	398,295.00	0.07
289	002493	荣盛石化	32,344	397,831.20	0.07
290	002039	黔源电力	23,439	396,587.88	0.07
291	601225	陕西煤业	53,228	383,773.88	0.07
292	600104	上汽集团	22,469	381,748.31	0.07
293	603096	新经典	6,400	377,792.00	0.07
294	002271	东方雨虹	9,290	377,452.70	0.07
295	000725	京东方 A	80,482	375,850.94	0.07
296	600297	广汇汽车	117,600	375,144.00	0.07

297	000786	北新建材	17,362	370,331.46	0.07
298	002027	分众传媒	66,400	369,848.00	0.07
299	002541	鸿路钢构	12,637	369,505.88	0.07
300	002832	比音勒芬	21,522	368,456.64	0.07
301	300236	上海新阳	6,098	366,245.88	0.07
302	002690	美亚光电	6,953	365,727.80	0.07
303	603486	科沃斯	12,100	365,541.00	0.07
304	002273	水晶光电	21,000	359,940.00	0.07
305	300481	濮阳惠成	18,600	358,608.00	0.06
306	600886	国投电力	45,545	357,983.70	0.06
307	601872	招商轮船	61,083	356,113.89	0.06
308	300408	三环集团	12,839	355,640.30	0.06
309	603181	皇马科技	15,494	351,713.80	0.06
310	600428	中远海特	114,058	351,298.64	0.06
311	600026	中远海能	54,240	350,390.40	0.06
312	000690	宝新能源	73,778	348,232.16	0.06
313	300133	华策影视	48,000	348,000.00	0.06
314	002064	华峰氨纶	68,308	346,321.56	0.06
315	002706	良信电器	20,617	343,891.56	0.06
316	603258	电魂网络	6,081	337,860.36	0.06
317	002851	麦格米特	13,000	336,960.00	0.06
318	300396	迪瑞医疗	12,500	336,000.00	0.06
319	600315	上海家化	7,000	335,300.00	0.06
320	300590	移为通信	10,296	335,237.76	0.06
321	600787	中储股份	76,200	334,518.00	0.06
322	603596	伯特利	9,500	334,400.00	0.06
323	002081	金螳螂	42,437	333,554.82	0.06
324	603777	来伊份	19,700	331,354.00	0.06
325	600159	大龙地产	136,200	330,966.00	0.06
326	601186	中国铁建	39,463	330,699.94	0.06
327	002301	齐心集团	20,001	328,416.42	0.06
328	002810	山东赫达	9,500	320,720.00	0.06
329	603803	瑞斯康达	27,400	320,032.00	0.06
330	601800	中国交建	43,372	318,350.48	0.06
331	688116	天奈科技	6,800	317,900.00	0.06
332	002223	鱼跃医疗	8,726	317,626.40	0.06
333	600449	宁夏建材	25,953	317,145.66	0.06
334	000552	靖远煤电	142,566	316,496.52	0.06
335	002655	共达电声	24,886	315,056.76	0.06

336	600125	铁龙物流	56,200	313,596.00	0.06
337	603899	晨光文具	5,696	311,001.60	0.06
338	000671	阳光城	48,533	307,699.22	0.06
339	601588	北辰实业	109,016	306,334.96	0.06
340	600050	中国联通	63,093	305,370.12	0.06
341	600745	闻泰科技	2,400	302,280.00	0.05
342	600380	健康元	18,600	302,064.00	0.05
343	603533	掌阅科技	7,900	301,227.00	0.05
344	000157	中联重科	46,805	300,956.15	0.05
345	603626	科森科技	24,534	298,088.10	0.05
346	600477	杭萧钢构	81,000	294,030.00	0.05
347	300604	长川科技	9,500	292,505.00	0.05
348	002675	东诚药业	13,900	291,205.00	0.05
349	603813	原尚股份	17,800	289,784.00	0.05
350	000921	海信家电	23,681	287,960.96	0.05
351	000961	中南建设	32,355	287,959.50	0.05
352	002721	金一文化	76,000	287,280.00	0.05
353	601088	中国神华	19,981	286,927.16	0.05
354	300377	赢时胜	30,600	285,804.00	0.05
355	300464	星徽精密	21,554	283,866.18	0.05
356	603612	索通发展	24,750	282,645.00	0.05
357	300124	汇川技术	7,400	281,126.00	0.05
358	300360	炬华科技	28,700	278,964.00	0.05
359	600132	重庆啤酒	3,793	276,889.00	0.05
360	300119	瑞普生物	12,328	275,530.80	0.05
361	300354	东华测试	22,600	275,042.00	0.05
362	688186	广大特材	8,033	274,326.95	0.05
363	002773	康弘药业	5,524	273,990.40	0.05
364	000544	中原环保	41,800	272,118.00	0.05
365	600989	宝丰能源	31,732	267,183.44	0.05
366	603367	辰欣药业	16,500	266,805.00	0.05
367	600546	山煤国际	22,636	265,973.00	0.05
368	600109	国金证券	23,249	265,271.09	0.05
369	603966	法兰泰克	26,696	263,756.48	0.05
370	002111	威海广泰	18,500	263,625.00	0.05
371	603686	龙马环卫	10,800	263,196.00	0.05
372	600038	中直股份	6,400	262,848.00	0.05
373	601808	中海油服	19,973	262,445.22	0.05
374	300476	胜宏科技	10,900	262,145.00	0.05

375	300251	光线传媒	23,600	257,476.00	0.05
376	603816	顾家家居	5,700	256,557.00	0.05
377	600219	南山铝业	126,100	255,983.00	0.05
378	002327	富安娜	36,058	253,848.32	0.05
379	300588	熙菱信息	26,393	250,469.57	0.05
380	000598	兴蓉环境	54,400	250,240.00	0.05
381	603659	璞泰来	2,401	247,351.02	0.04
382	600386	北巴传媒	71,100	245,295.00	0.04
383	002600	领益智造	22,853	242,927.39	0.04
384	601966	玲珑轮胎	11,875	239,875.00	0.04
385	000800	一汽解放	22,200	238,428.00	0.04
386	002129	中环股份	10,575	237,514.50	0.04
387	300417	南华仪器	13,000	235,040.00	0.04
388	002080	中材科技	15,045	233,197.50	0.04
389	002393	力生制药	8,800	232,056.00	0.04
390	600097	开创国际	25,100	230,669.00	0.04
391	300755	华致酒行	7,100	230,040.00	0.04
392	603566	普莱柯	8,187	226,698.03	0.04
393	600323	瀚蓝环境	10,300	225,364.00	0.04
394	603317	天味食品	4,039	224,487.62	0.04
395	002001	新和成	7,704	224,186.40	0.04
396	600729	重庆百货	7,162	223,597.64	0.04
397	600641	万业企业	9,473	222,615.50	0.04
398	002734	利民股份	14,800	221,556.00	0.04
399	300088	长信科技	19,700	220,640.00	0.04
400	603501	韦尔股份	1,088	219,721.60	0.04
401	300207	欣旺达	11,500	217,350.00	0.04
402	600308	华泰股份	46,600	214,360.00	0.04
403	600004	白云机场	13,800	210,312.00	0.04
404	300424	航新科技	15,700	210,066.00	0.04
405	002049	紫光国微	2,882	209,665.50	0.04
406	002019	亿帆医药	8,985	206,385.45	0.04
407	002245	澳洋顺昌	52,453	202,993.11	0.04
408	300190	维尔利	26,579	200,671.45	0.04
409	000915	山大华特	6,100	199,775.00	0.04
410	000581	威孚高科	9,640	199,355.20	0.04
411	000739	普洛药业	8,500	197,965.00	0.04
412	002563	森马服饰	28,026	197,583.30	0.04
413	000830	鲁西化工	26,400	196,944.00	0.04

414	002677	浙江美大	17,300	195,144.00	0.04
415	603315	福鞍股份	14,900	194,594.00	0.04
416	600057	厦门象屿	33,600	184,128.00	0.03
417	300224	正海磁材	21,243	183,964.38	0.03
418	002008	大族激光	5,100	183,345.00	0.03
419	603806	福斯特	3,664	182,870.24	0.03
420	601857	中国石油	43,161	180,844.59	0.03
421	603218	日月股份	9,839	180,053.70	0.03
422	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.03
423	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.03
424	300274	阳光电源	12,400	178,436.00	0.03
425	600521	华海药业	5,200	176,436.00	0.03
426	002661	克明面业	7,600	176,168.00	0.03
427	300066	三川智慧	35,786	176,067.12	0.03
428	603558	健盛集团	20,247	174,529.14	0.03
429	002035	华帝股份	17,200	174,236.00	0.03
430	603421	鼎信通讯	11,500	172,270.00	0.03
431	600897	厦门空港	9,568	171,362.88	0.03
432	600382	广东明珠	26,100	170,694.00	0.03
433	000656	金科股份	20,900	170,544.00	0.03
434	600999	招商证券	7,500	164,625.00	0.03
435	603320	迪贝电气	13,220	163,267.00	0.03
436	601390	中国中铁	32,256	161,925.12	0.03
437	002508	老板电器	5,168	160,776.48	0.03
438	601985	中国核电	39,000	159,510.00	0.03
439	300413	芒果超媒	2,423	157,979.60	0.03
440	600206	有研新材	11,300	157,861.00	0.03
441	600178	东安动力	35,400	157,530.00	0.03
442	000733	振华科技	7,000	157,430.00	0.03
443	002683	宏大爆破	4,500	157,050.00	0.03
444	300659	中孚信息	2,600	156,052.00	0.03
445	603068	博通集成	1,900	153,102.00	0.03
446	300087	荃银高科	11,502	152,746.56	0.03
447	600180	瑞茂通	23,903	152,501.14	0.03
448	300622	博士眼镜	12,100	152,097.00	0.03
449	300129	泰胜风能	40,600	149,002.00	0.03
450	600340	华夏幸福	6,452	147,492.72	0.03
451	002241	歌尔股份	5,000	146,800.00	0.03
452	002216	三全食品	6,100	145,790.00	0.03

453	600967	内蒙一机	14,000	145,460.00	0.03
454	300573	兴齐眼药	1,000	145,000.00	0.03
455	002550	千红制药	33,500	144,720.00	0.03
456	000034	神州数码	5,900	143,606.00	0.03
457	000863	三湘印象	33,700	142,888.00	0.03
458	002538	司尔特	29,600	142,376.00	0.03
459	603589	口子窖	2,788	141,909.20	0.03
460	600597	光明乳业	9,400	139,684.00	0.03
461	601009	南京银行	18,707	137,122.31	0.02
462	600028	中国石化	34,872	136,349.52	0.02
463	002433	太安堂	31,100	136,218.00	0.02
464	600305	恒顺醋业	7,310	135,600.50	0.02
465	600650	锦江投资	14,400	133,344.00	0.02
466	002171	楚江新材	14,200	132,628.00	0.02
467	600705	中航资本	33,309	131,903.64	0.02
468	600717	天津港	29,600	130,832.00	0.02
469	600987	航民股份	24,300	130,005.00	0.02
470	002262	恩华药业	7,709	129,973.74	0.02
471	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
472	002368	太极股份	2,950	128,885.50	0.02
473	603214	爱婴室	4,177	128,108.59	0.02
474	600499	科达洁能	31,079	128,045.48	0.02
475	603888	新华网	5,700	127,452.00	0.02
476	600837	海通证券	10,098	127,032.84	0.02
477	300010	立思辰	6,480	126,813.60	0.02
478	601339	百隆东方	37,619	126,776.03	0.02
479	002316	亚联发展	21,600	126,576.00	0.02
480	601366	利群股份	20,600	125,866.00	0.02
481	600690	海尔智家	7,088	125,457.60	0.02
482	601818	光大银行	34,804	124,598.32	0.02
483	600012	皖通高速	24,000	124,560.00	0.02
484	600060	海信视像	10,200	123,930.00	0.02
485	002291	星期六	5,357	123,746.70	0.02
486	300331	苏大维格	4,077	123,492.33	0.02
487	300440	运达科技	12,300	123,123.00	0.02
488	300815	玉禾田	1,000	122,640.00	0.02
489	300435	中泰股份	12,500	122,375.00	0.02
490	600606	绿地控股	19,773	122,197.14	0.02
491	600756	浪潮软件	6,600	122,100.00	0.02

492	601098	中南传媒	11,533	122,019.14	0.02
493	000902	新洋丰	13,626	120,453.84	0.02
494	600933	爱柯迪	8,561	119,169.12	0.02
495	603060	国检集团	5,900	117,941.00	0.02
496	002244	滨江集团	27,500	117,425.00	0.02
497	601222	林洋能源	21,400	116,844.00	0.02
498	603383	顶点软件	2,608	116,290.72	0.02
499	300209	天泽信息	6,739	115,641.24	0.02
500	300628	亿联网络	1,686	115,086.36	0.02
501	600303	曙光股份	35,100	114,777.00	0.02
502	300438	鹏辉能源	6,500	113,425.00	0.02
503	600266	城建发展	22,320	113,162.40	0.02
504	688169	石头科技	300	113,070.00	0.02
505	600963	岳阳林纸	31,700	112,535.00	0.02
506	002036	联创电子	8,900	111,250.00	0.02
507	300684	中石科技	3,200	111,040.00	0.02
508	002456	欧菲光	6,000	110,340.00	0.02
509	600128	弘业股份	16,500	110,055.00	0.02
510	600291	西水股份	12,136	109,830.80	0.02
511	601211	国泰君安	6,330	109,255.80	0.02
512	002707	众信旅游	15,124	108,892.80	0.02
513	600882	妙可蓝多	3,000	108,870.00	0.02
514	300405	科隆股份	19,067	108,109.89	0.02
515	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
516	600711	盛屯矿业	20,851	107,174.14	0.02
517	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.02
518	600783	鲁信创投	6,926	105,967.80	0.02
519	601965	中国汽研	12,100	105,512.00	0.02
520	601689	拓普集团	3,742	104,401.80	0.02
521	300285	国瓷材料	3,100	103,881.00	0.02
522	600715	文投控股	38,900	103,863.00	0.02
523	002390	信邦制药	22,736	103,676.16	0.02
524	600958	东方证券	10,864	103,099.36	0.02
525	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
526	000906	浙商中拓	17,600	101,376.00	0.02
527	603721	中广天择	4,200	100,632.00	0.02
528	300084	海默科技	25,857	100,325.16	0.02
529	300298	三诺生物	3,100	99,634.00	0.02
530	603180	金牌厨柜	2,083	98,275.94	0.02

531	300416	苏试试验	4,300	97,223.00	0.02
532	300356	光一科技	17,300	96,880.00	0.02
533	002139	拓邦股份	17,009	95,760.67	0.02
534	002665	首航高科	39,070	95,330.80	0.02
535	002304	洋河股份	900	94,626.00	0.02
536	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
537	300250	初灵信息	7,128	93,661.92	0.02
538	601000	唐山港	42,000	93,660.00	0.02
539	002572	索菲亚	3,846	92,957.82	0.02
540	300378	鼎捷软件	6,800	92,480.00	0.02
541	600131	国网信通	4,864	92,270.08	0.02
542	603689	皖天然气	9,300	92,256.00	0.02
543	000918	嘉凯城	19,499	91,645.30	0.02
544	600071	凤凰光学	9,400	91,274.00	0.02
545	600694	大商股份	3,800	91,162.00	0.02
546	300256	星星科技	14,284	90,560.56	0.02
547	600322	天房发展	34,449	89,911.89	0.02
548	300771	智莱科技	2,357	89,094.60	0.02
549	603568	伟明环保	3,800	88,160.00	0.02
550	600611	大众交通	23,400	87,984.00	0.02
551	603903	中持股份	4,823	87,633.91	0.02
552	601718	际华集团	26,000	86,320.00	0.02
553	002230	科大讯飞	2,300	86,089.00	0.02
554	002959	小熊电器	695	85,485.00	0.02
555	603601	再升科技	6,500	85,150.00	0.02
556	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
557	002106	莱宝高科	6,400	84,096.00	0.02
558	603729	龙韵股份	4,000	82,280.00	0.01
559	002449	国星光电	7,067	81,977.20	0.01
560	000829	天音控股	12,500	81,875.00	0.01
561	002777	久远银海	2,692	81,863.72	0.01
562	603727	博迈科	4,600	81,650.00	0.01
563	600885	宏发股份	2,014	80,801.68	0.01
564	601933	永辉超市	8,500	79,730.00	0.01
565	002760	凤形股份	3,500	79,555.00	0.01
566	002970	锐明技术	1,150	78,579.50	0.01
567	002833	弘亚数控	3,200	78,496.00	0.01
568	300101	振芯科技	7,000	77,350.00	0.01
569	603008	喜临门	7,200	77,256.00	0.01

570	601003	柳钢股份	17,300	76,639.00	0.01
571	300192	科斯伍德	4,404	74,339.52	0.01
572	002238	天威视讯	10,790	73,264.10	0.01
573	000728	国元证券	8,705	73,122.00	0.01
574	000050	深天马 A	4,700	72,192.00	0.01
575	600299	安迪苏	5,824	71,169.28	0.01
576	600612	老凤祥	1,459	70,309.21	0.01
577	300162	雷曼光电	10,300	69,834.00	0.01
578	300034	钢研高纳	3,700	69,412.00	0.01
579	000969	安泰科技	10,434	68,864.40	0.01
580	002372	伟星新材	5,700	66,291.00	0.01
581	603167	渤海轮渡	8,400	65,856.00	0.01
582	002180	纳思达	1,998	65,754.18	0.01
583	600398	海澜之家	11,176	65,044.32	0.01
584	002063	远光软件	4,886	61,710.18	0.01
585	002749	国光股份	4,600	58,420.00	0.01
586	000401	冀东水泥	3,069	49,226.76	0.01
587	688012	中微公司	194	42,546.14	0.01
588	002324	普利特	2,040	30,620.40	0.01
589	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
590	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
591	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
592	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
593	000959	首钢股份	2,832	12,177.60	0.00
594	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
595	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
596	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
597	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
598	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002371	北方华创	13,486,930.00	2.92
2	300251	光线传媒	11,590,557.00	2.51
3	300014	亿纬锂能	11,435,184.02	2.47

4	600438	通威股份	11,175,620.00	2.42
5	601677	明泰铝业	10,936,887.24	2.37
6	600519	贵州茅台	10,572,500.00	2.29
7	600763	通策医疗	10,373,897.21	2.24
8	600161	天坛生物	9,615,350.29	2.08
9	300357	我武生物	9,397,607.20	2.03
10	603986	兆易创新	9,311,558.19	2.01
11	000898	鞍钢股份	9,070,282.34	1.96
12	300770	新媒股份	8,996,929.00	1.95
13	600486	扬农化工	8,929,561.27	1.93
14	002439	启明星辰	8,716,103.10	1.89
15	002025	航天电器	8,657,432.00	1.87
16	600570	恒生电子	8,470,983.90	1.83
17	300573	兴齐眼药	8,434,320.00	1.82
18	300724	捷佳伟创	8,432,571.00	1.82
19	002396	星网锐捷	8,313,764.73	1.80
20	603444	吉比特	8,090,303.00	1.75

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	600745	闻泰科技	15,762,470.70	3.41
2	601689	拓普集团	12,733,899.90	2.75
3	002368	太极股份	12,482,886.26	2.70
4	600486	扬农化工	12,442,114.01	2.69
5	603501	韦尔股份	11,912,558.83	2.58
6	300253	卫宁健康	11,781,168.58	2.55
7	600763	通策医疗	11,647,970.04	2.52
8	603986	兆易创新	10,730,508.33	2.32
9	300552	万集科技	10,663,110.60	2.31
10	601231	环旭电子	10,655,959.80	2.30
11	300357	我武生物	10,516,231.49	2.27
12	300251	光线传媒	10,446,298.04	2.26
13	600438	通威股份	10,255,215.37	2.22
14	603444	吉比特	10,151,783.73	2.20

15	603659	璞泰来	10,088,329.27	2.18
16	002371	北方华创	10,014,051.16	2.17
17	002821	凯莱英	9,830,390.31	2.13
18	300573	兴齐眼药	9,719,099.33	2.10
19	000829	天音控股	9,391,296.29	2.03
20	300014	亿纬锂能	9,384,306.61	2.03
21	600267	海正药业	9,290,650.41	2.01

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	1,888,334,396.84
卖出股票收入（成交）总额	1,943,906,711.50

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,001,500.00	0.18
	其中：政策性金融债	1,001,500.00	0.18
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	1,001,500.00	0.18

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	018007	国开 1801	10,000	1,001,500.00	0.18

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

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

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

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**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2007	IC2007	40	46,395,200.00	1,416,720.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,416,720.00
股指期货投资本期收益（元）					4,317,598.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,416,720.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	6,111,827.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	39,561.27
5	应收申购款	58,450.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,209,839.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	601816	京沪高铁	5,593,327.12	1.01	新股锁定

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

份额级别	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
银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	147	3,237,031.88	474,299,892.29	99.68%	1,543,794.34	0.32%
银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	257	2,633.52	-	0.00%	676,815.32	100.00%
合计	404	1,179,506.19	474,299,892.29	99.53%	2,220,609.66	0.47%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	954.19	0.00%
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	32,820.98	4.85%
	合计	33,775.17	0.01%

截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	份额级别	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	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	0
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	0~10
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,400.14	2.10	10,001,400.14	2.10	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,400.14	2.10	10,001,400.14	2.10	3 年

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,001,400.14 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 1,400.14 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳健增利灵 活配置混合发起 式 A	银华稳健增利灵 活配置混合发起 式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）基金 份额总额	12,089,589.79	1,086,315.48
本报告期期初基金份额总额	475,423,736.19	1,823,966.88
本报告期基金总申购份额	1,404,166.30	793,464.66
减：本报告期基金总赎回份额	984,215.86	1,940,616.22
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	475,843,686.63	676,815.32

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金由安永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内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	
兴业证券股份有限公司	1	626,313,457.53	16.40%	583,286.37	19.11%	-
中泰证券股份有限公司	4	551,681,773.14	14.45%	513,782.19	16.84%	新增 1 个交易单元
东方财富证券股份有限公司	2	403,423,185.23	10.56%	134,374.02	4.40%	新增 2 个交易单元
招商证券股份有限公司	1	378,639,807.96	9.91%	352,628.65	11.56%	-

野村东方国际证券有限公司	2	375,687,979.99	9.84%	274,742.50	9.00%	新增 2 个交易日
光大证券股份有限公司	1	364,964,683.71	9.56%	339,892.21	11.14%	-
国盛证券股份有限公司	2	340,041,704.63	8.90%	248,673.88	8.15%	-
东吴证券股份有限公司	2	295,109,423.92	7.73%	215,814.01	7.07%	-
中航证券有限公司	2	253,892,766.62	6.65%	185,671.48	6.08%	-
瑞银证券有限责任公司	1	176,070,197.10	4.61%	163,973.86	5.37%	-
浙商证券股份有限公司	1	53,172,711.33	1.39%	38,885.33	1.27%	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西藏同信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增 1 个交易日
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	0	-	-	-	-	撤销 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
平安证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-

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
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	-	-	-	-	-	-

公司						
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	1,008,100.00	100.00%	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-

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	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式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》	中国证券报、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7日
2	《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
3	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
4	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的浪潮信息估值方法调整的公告》	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13日
5	《银华基金管理股份有限公司	四大证券报、中国证	2020年3月24日

	司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告》	监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	
6	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的闻泰科技估值方法调整的公告》	中国证券报、上海证券报、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
7	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式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 25 日
8	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式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 25 日
9	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式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 3 月 25 日
10	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式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 3 月 25 日
11	《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 13 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 25 日
12	《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
13	《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
14	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
15	《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
16	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 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

§ 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

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	2020/01/01-2020/06/30	116,435,838.87	0.00	0.00	116,435,838.87	24.43%
	2	2020/01/01-2020/06/30	231,908,826.64	0.00	0.00	231,908,826.64	48.67%
	3	2020/01/01-2020/06/30	115,953,826.64	0.00	0.00	115,953,826.64	24.33%

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，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。

11.2 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 25 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 13 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式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

2020 年 8 月 28 日