

# 银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	20
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.....	22
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	23
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	24
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.....	24
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>25</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	25
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.....	25
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.....	25
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>26</b>
6.1 审计报告基本信息.....	26
6.2 审计报告的基本内容.....	26
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>29</b>
7.1 资产负债表.....	29
7.2 利润表.....	30
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	31
7.4 报表附注.....	32
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>62</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	62
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	62
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.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	87
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.....	87
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.....	87

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 .....	87
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 .....	87
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	87
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	88
8.12	投资组合报告附注 .....	88
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>89</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	89
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	89
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 .....	90
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	90
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>91</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>92</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	92
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 .....	92
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	92
11.4	基金投资策略的改变 .....	92
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	92
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 .....	92
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	92
11.8	其他重大事件 .....	96
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>99</b>
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	99
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	99
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>100</b>
13.1	备查文件目录 .....	100
13.2	存放地点 .....	100
13.3	查阅方式 .....	100

## § 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	476,790,901.49 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	475,911,840.40 份	879,061.09 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。

### 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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	
	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	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	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
本期已实现收益	181,398,602.65	356,462.25	35,675,173.20	216,141.33	-3,118,616.31	-282,990.51
本期利润	207,398,013.21	387,602.49	52,235,993.46	277,731.86	-3,397,848.22	-307,644.61
加权平均基金份额本期利润	0.4359	0.4211	0.2578	0.1494	-0.2827	-0.2942
本期加权	36.79%	35.62%	28.30%	17.25%	-32.68%	-34.08%

平均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	45.00%	44.51%	34.84%	34.45%	-28.24%	-28.38%
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	132,631,510.94	235,229.86	-48,765,272.18	-195,448.75	-3,370,875.38	-307,752.12
期末可供分配基金份额	0.2787	0.2676	-0.1026	-0.1072	-0.2815	-0.2831



利润						
期末基金资产净值	668,556,155.83	1,224,479.33	460,608,683.17	1,758,171.51	8,603,137.48	779,406.18
期末基金份额净值	1.4048	1.3929	0.9688	0.9639	0.7185	0.7169
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	40.48%	39.29%	-3.12%	-3.61%	-28.15%	-28.31%

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
过去三个月	8.09%	1.11%	5.98%	0.50%	2.11%	0.61%
过去六个月	21.10%	1.36%	9.80%	0.66%	11.30%	0.70%
过去一年	45.00%	1.49%	12.86%	0.70%	32.14%	0.79%
过去三年	40.31%	1.22%	16.49%	0.66%	23.82%	0.56%
自基金合同生效起至今	40.48%	1.21%	16.50%	0.66%	23.98%	0.55%

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
过去三个月	7.99%	1.11%	5.98%	0.50%	2.01%	0.61%
过去六个月	20.89%	1.36%	9.80%	0.66%	11.09%	0.70%
过去一年	44.51%	1.49%	12.86%	0.70%	31.65%	0.79%
过去三年	39.15%	1.22%	16.49%	0.66%	22.66%	0.56%
自基金合同生效起至今	39.29%	1.21%	16.50%	0.66%	22.79%	0.55%

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%

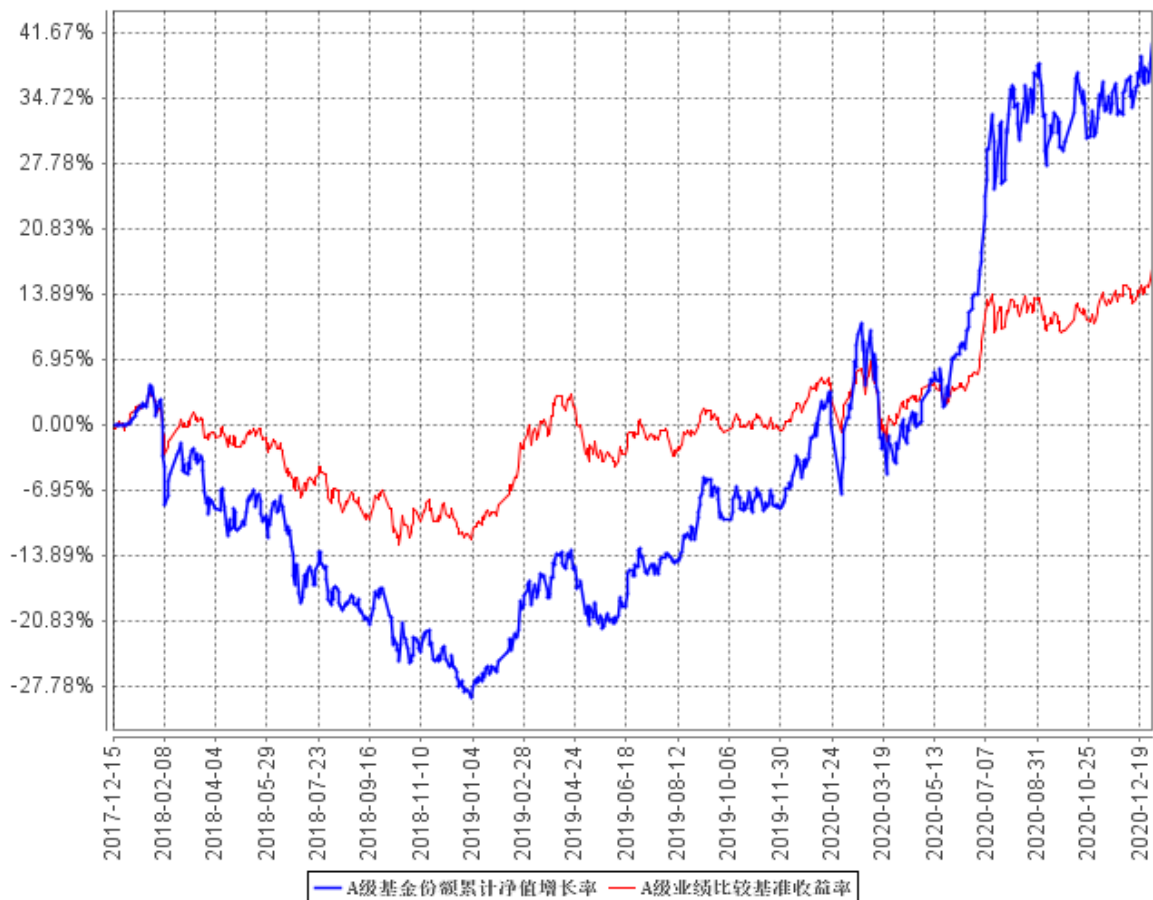
中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 800 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模居前、流动性良好的股票，目前中证 800 指数样本覆盖了沪深市场近八成左右的市值，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，其选样是所有流通的符合指数设计原则的记账式国债、央行票据和政策性银行债，是综合反映境内利率类债券整体价格走势情况的债券指数。

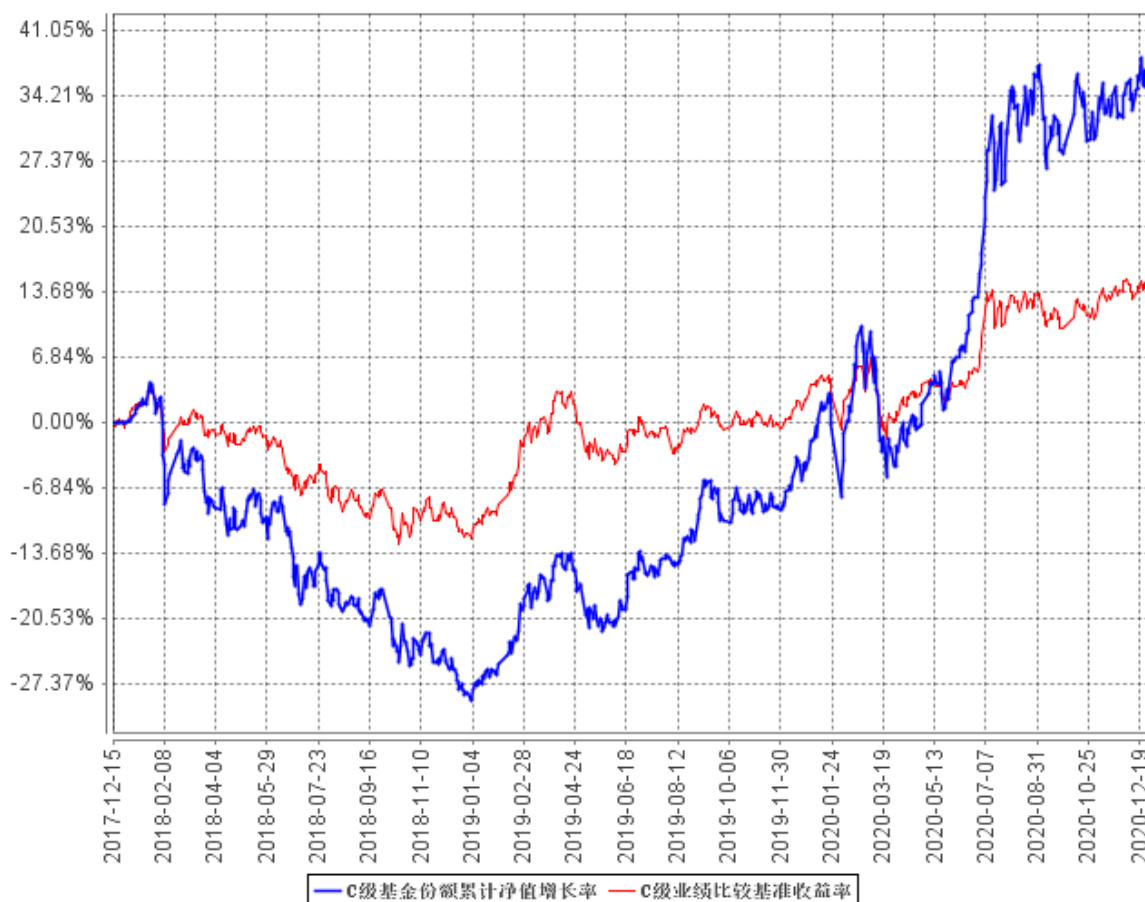
本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 0%-95% 的股票资产，其余资产主要投资于权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具。因此，“中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

### 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



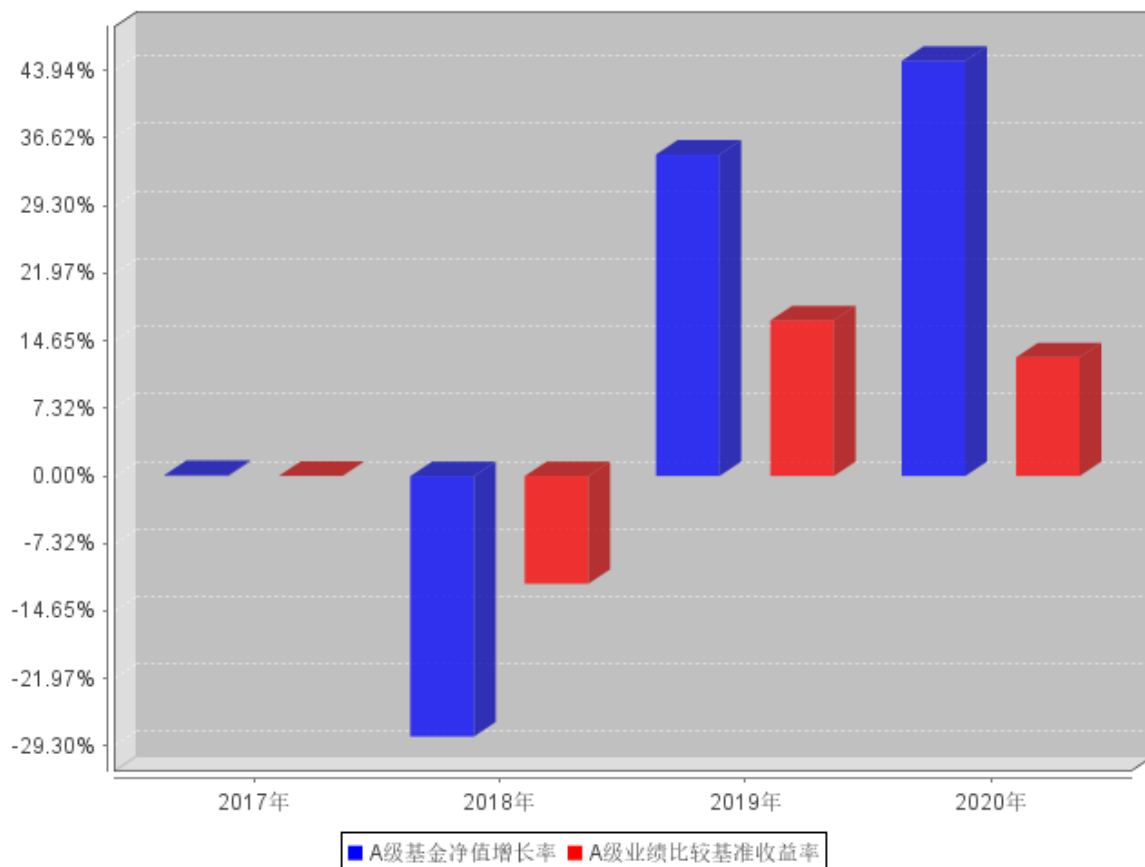
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



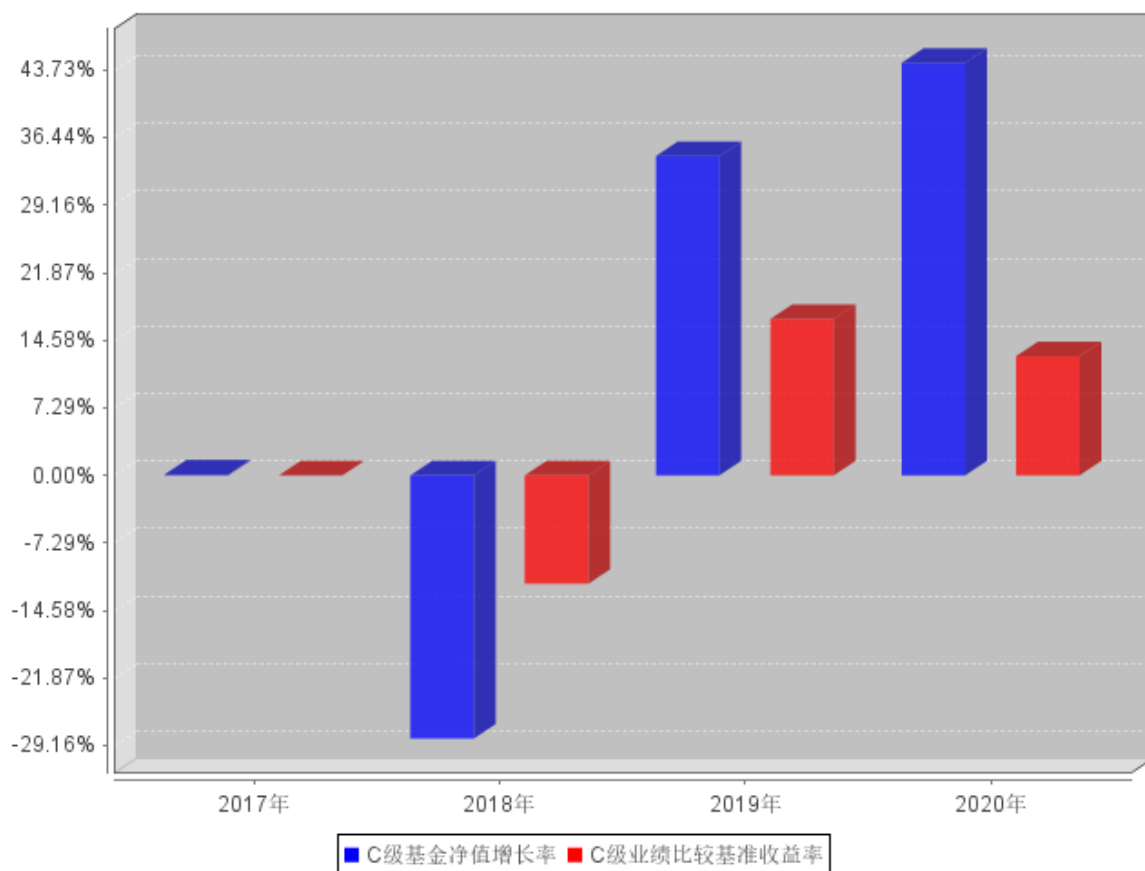
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 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

A级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对比图



C级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对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2020 年度、2019 年度、2018 年度会计期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 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		
马君女士	本基金的基金经理	2017年12月15日	-	12.5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日至2020年11月30日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

				<p>华消费主题分级混合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 日至 2021 年 2 月 25 日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 日至 2020 年 12 月 10 日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 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华食品饮料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 日起兼任银华中小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</p>
--	--	--	--	--

					<p>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，自 2020 年 9 月 22 日起兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任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）基金经理，自 2020 年 12 月 10 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
杨腾先生	本基金的基金经理助理	2017年12月15日	-	8.5 年	<p>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。</p>
谭跃峰先	本基金的	2020 年 1 月	-	9.5 年	<p>学士学位，曾就职于</p>

生	基金经理 助理	10 日			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。

3、由于本基金基金经理马君女士因个人原因（休产假）无法正常履行职务，本基金管理人决定自 2021 年 3 月 3 日起暂由本公司基金经理李宜璇女士代为管理本基金。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华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 1.4048 元，本报告期基金份额净值增长率为 45.00%；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 1.3929 元，本报告期基金份额净值增长率为 44.51%；同期业绩比较基准收益率为 12.86%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，新冠疫情成为 2020 年全球经济的最大预期外变量。随着疫情在国内快速得到控制，国内经济得以在较短时间内逐步推进复苏。全年来看，虽然有局部的零星疫情复发，但均没有改变全国范围内复工复产的整体格局。而在国际层面，疫情的控制程度显著劣于国内。在这种国内国外疫情控制的“剪刀差”背景下，全球范围内正在发生产业链的潜在重构，而中国产业链显著受益。在上述因素的作用下，下半年以来出口数据持续超预期。进入 2021 年之后，我们认为全球产业链重构仍将是全球经济版图变化的重要驱动因素。在这一基准判断下，我们对 2021 年的中国经济继续保持乐观。

企业估值层面，我们认为 2020 年全球市场的良好表现，与疫情背景下的各大央行货币宽松高度关联。至于 A 股市场，则是同时受益于居民资产配置方式转变、海外资金流入与全球产业链重

构等多重因素的共振。进入 2021 年之后，我们认为这些影响因素仍将持续发挥作用。风险层面，我们认为 2021 年的主要风险来自于海外流动性状况的变化、海外疫情控制与全球范围内的地缘摩擦事件。基于上述判断，我们认为 A 股市场仍将持续存在机会。在此过程中，我们继续看好龙头类公司的超额收益。

#### 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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，未进行利润分配。

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

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



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 年年度报告中财务指标、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 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	安永华明（2021）审字第 61329181_A54 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	银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了银华稳健增利灵活配置混合型发起式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，后附的银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 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，我们独立于银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金，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	银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估银华稳健增利灵活配置混合型

	<p>发起式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,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对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,就可能导致对银华稳健增利灵活配置混合型发起式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稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金</p>

	<p>不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊   贺耀
会计师事务所的地址	中国 北京
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 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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	51,480,153.18	23,981,280.87
结算备付金		13,456,694.14	10,495,050.78
存出保证金		2,902,172.39	174,815.65
交易性金融资产	7.4.7.2	602,987,361.70	429,685,726.89
其中：股票投资		602,987,361.70	429,685,726.89
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	12,150.95	11,177.63
应收股利		-	-
应收申购款		822.37	10,252.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		670,839,354.73	464,358,304.70
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	78.75
应付赎回款		3,937.24	32,762.56
应付管理人报酬		330,221.16	229,340.66
应付托管费		82,555.30	57,335.19
应付销售服务费		340.68	544.17
应付交易费用	7.4.7.7	476,665.19	1,626,386.42
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	165,000.00	45,002.27
负债合计		1,058,719.57	1,991,450.02
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	476,790,901.49	477,247,703.07
未分配利润	7.4.7.10	192,989,733.67	-14,880,848.39
所有者权益合计		669,780,635.16	462,366,854.68
负债和所有者权益总计		670,839,354.73	464,358,304.70

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 类基金份额净值人民币 1.4048 元，银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 类基金份额净值人民币 1.3929 元；基金份额总额 476,790,901.49 份，其中银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 类基金份额总额 475,911,840.40 份，银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 类基金份额总额 879,061.09 份。

## 7.2 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 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
<b>一、收入</b>		221,254,062.83	59,441,653.01
1.利息收入		462,534.63	317,041.10
其中：存款利息收入	7.4.7.11	443,239.23	271,615.65
债券利息收入		19,295.40	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	45,425.45
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		194,751,274.02	42,196,667.26
其中：股票投资收益	7.4.7.12	178,853,538.56	39,371,813.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-8,100.00	-
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	10,828,784.47	2,436,514.17
股利收益	7.4.7.16	5,077,050.99	388,339.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	26,030,550.80	16,622,410.79
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	9,703.38	305,533.86
<b>减：二、费用</b>		13,468,447.13	6,927,927.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,371,831.72	1,563,171.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	842,957.98	279,013.42
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,814.04	5,766.79
4. 交易费用	7.4.7.19	9,043,927.78	4,910,548.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		39,073.61	2,722.30
7. 其他费用	7.4.7.20	166,842.00	166,705.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		207,785,615.70	52,513,725.32
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		207,785,615.70	52,513,725.32

### 7.3 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）	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）	-	207,785,615.70	207,785,615.70
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）	-456,801.58	84,966.36	-371,835.22
其中：1. 基金申购款	4,535,529.51	817,389.90	5,352,919.41
2. 基金赎回款	-4,992,331.09	-732,423.54	-5,724,754.63
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）	476,790,901.49	192,989,733.67	669,780,635.16
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）	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）	-	52,513,725.32	52,513,725.32
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）	464,186,531.91	-63,715,946.21	400,470,585.70
其中：1. 基金申购款	587,213,386.18	-68,773,054.13	518,440,332.05
2. 基金赎回款	-123,026,854.27	5,057,107.92	-117,969,746.35
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）	477,247,703.07	-14,880,848.39	462,366,854.68

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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，基金合同于2017年12月15日生效，首次设立募集规模为13,175,905.27份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人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。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%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

## 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

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

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（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利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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；

(4) 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收益/（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，并于期末全额转入“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及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，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票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，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），在回购期内逐日计提；

(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）于交易日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于股指期货合约平仓和到期交割日确认，并按平仓和到期交割日成交金额与其成本的差额入账；

(8) 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；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 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费用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、在符合有关基金分红条件的前提下，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、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相应类别的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；

3、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每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，并于变更实施日前在指定媒介上公告，且不

需召开基金份额持有人大会。

#### 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

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 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。

#### 7.4.6.3 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。

#### 7.4.6.4 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。

#### 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	51,480,153.18	23,981,280.87
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：	51,480,153.18	23,981,280.87

##### 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	561,278,766.12	602,987,361.70	41,708,595.58
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	561,278,766.12	602,987,361.70	41,708,595.58

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	413,367,202.11	429,685,726.89	16,318,524.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	413,367,202.11	429,685,726.89	16,318,524.78

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	18,206,120.00	-	-	
股指期货投资	18,206,120.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	18,206,120.00	-	-	
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 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	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

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 12 月 31 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：IC2101 买入持仓量 5 手，合约市值人民币 6,343,800.00 元，公允价值变动人民币 159,280.00 元。IC2103 买入持仓量 10 手，合约市值人民币 12,502,800.00 元，公允价值变动人民币 481,200.00 元。

**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**

注：无。

**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	5,855.27	9,766.11
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	6,258.39	1,324.95
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
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	37.29	86.57
合计	12,150.95	11,177.63

**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	476,665.19	1,626,386.42
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	476,665.19	1,626,386.42

**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	-	2.27
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	165,000.00	45,000.00
合计	165,000.00	45,002.27

#### 7.4.7.9 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12月31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	2,605,691.45	2,605,691.45
本期赎回（以“-”号填列）	-2,117,587.24	-2,117,587.24
- 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	475,911,840.40	475,911,840.40

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12月31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	1,929,838.06	1,929,838.06
本期赎回（以“-”号填列）	-2,874,743.85	-2,874,743.85
- 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	879,061.09	879,061.09

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

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	181,398,602.65	25,999,410.56	207,398,013.21
本期基金份额交易产生的变动数	-1,819.53	63,174.77	61,355.24
其中：基金申购款	192,773.41	255,341.71	448,115.12
基金赎回款	-194,592.94	-192,166.94	-386,759.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,631,510.94	60,012,804.49	192,644,315.43

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	356,462.25	31,140.24	387,602.49
本期基金份额交易产生的变动数	74,216.36	-50,605.24	23,611.12
其中：基金申购款	159,903.87	209,370.91	369,274.78
基金赎回款	-85,687.51	-259,976.15	-345,663.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	235,229.86	110,188.38	345,418.24

#### 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	229,878.70	235,111.61
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	98,719.93	23,847.13
其他	114,640.60	12,656.91
合计	443,239.23	271,615.65

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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	4,134,667,204.51	1,602,081,132.75
减：卖出股票成本总额	3,955,813,665.95	1,562,709,318.84
买卖股票差价收入	178,853,538.56	39,371,813.91

### 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	-8,100.00	-
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	-8,100.00	-

#### 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	3,932,620.00	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,808,100.00	-
减：应收利息总额	132,620.00	-
买卖债券差价收入	-8,100.00	-

#### 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

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.2 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	上年度可比期间收益金额
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	10,828,784.47	2,436,514.17

## 7.4.7.16 股利收益

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12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,077,050.99	388,339.18
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	5,077,050.99	388,339.18

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	25,390,070.80	16,622,410.79
——股票投资	25,390,070.80	16,622,410.79
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	640,480.00	-
——权证投资	-	-
股指期货投资	640,480.00	-
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	26,030,550.80	16,622,410.79

**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	7,752.40	285,533.86
转换费收入	1,950.98	-
其他	-	20,000.00
合计	9,703.38	305,533.86

**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	9,043,927.78	4,910,548.02
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	9,043,927.78	4,910,548.02

**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	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,842.00	1,705.67
合计	166,842.00	166,705.67

**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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

### 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、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东
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
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
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	-	-	126,547,468.66	3.56%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 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
-	-	-	-	-
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
东北证券	92,543.29	3.13%	1,570.93	0.10%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	3,371,831.72

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	7,094.34	13,077.90

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 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

#### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	842,957.98	279,013.42

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% 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

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 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	-	55.46	55.46
中国工商银行	-	729.35	729.35
合计	-	784.81	784.81
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 12 月 31 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	-	54.92	54.92
中国工商银行	-	2,147.79	2,147.79
合计	-	2,202.71	2,202.71

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 类基金份额前一日基金资产净值

#### 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

##### 7.4.10.5.1 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 12 月 31 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	-	-
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 12 月 31 日	
	银华稳健增利灵活配置混合	银华稳健增利灵活配置混合

	发起式 A	发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
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%	-

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。

#### 7.4.10.5.2 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

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
中国工商银行	51,480,153.18	229,878.70	23,981,280.87	235,111.61

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末（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

7.4.12.1.1 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
688063	派能科技	2020年12月22日	2021年6月30日	新发流通受限	56.00	189.24	3,437	192,472.00	650,417.88	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新发流通受限	25.70	88.29	3,104	79,772.80	274,052.16	-
688330	宏力达	2020年9月28日	2021年4月15日	新发流通受限	88.23	75.87	2,712	239,279.76	205,759.44	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新发流通受限	118.27	603.36	232	27,438.64	139,979.52	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	新发流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
688585	上纬新材	2020年9月21日	2021年3月29日	新发流通受限	2.49	12.51	4,922	12,255.78	61,574.22	-
688308	欧科亿	2020年12月3日	2021年6月10日	新发流通受限	23.99	23.41	2,457	58,943.43	57,518.37	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新发流通受限	43.76	51.10	722	31,594.72	36,894.20	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新发流通受限	24.60	61.51	537	13,210.20	33,030.87	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	配股流通受限	4.59	5.46	6,049	27,764.91	33,027.54	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	新发流通受限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新发流通受限	138.02	126.67	247	34,090.94	31,287.49	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	新发流通受限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300868	杰美特	2020年8月12日	2021年2月24日	新发流通受限	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新发流通受限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新发流通受限	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300878	维康	2020年8月17日	2021年3月3日	新发流通	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-

	药业	日	日	受限							
300891	惠云 钛业	2020年9月10 日	2021年3月 17日	新发流通 受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-	
300884	狄耐 克	2020年11月5 日	2021年5月 12日	新发流通 受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-	
300898	熊猫 乳品	2020年10月9 日	2021年4月 16日	新发流通 受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-	
300892	品渥 食品	2020年9月11 日	2021年3月 24日	新发流通 受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-	
300909	汇创 达	2020年11月 11日	2021年5月 18日	新发流通 受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-	
300887	谱尼 测试	2020年9月9 日	2021年3月 16日	新发流通 受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-	
300864	南大 环境	2020年8月13 日	2021年2月 25日	新发流通 受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-	
300889	爱克 股份	2020年9月9 日	2021年3月 16日	新发流通 受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-	
300890	翔丰 华	2020年9月10 日	2021年3月 18日	新发流通 受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-	
300902	国安 达	2020年10月 22日	2021年4月 29日	新发流通 受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-	
300925	法本 信息	2020年12月 21日	2021年6月 30日	新发流通 受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-	
300895	铜牛 信息	2020年9月17 日	2021年3月 24日	新发流通 受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-	
300876	蒙泰 高新	2020年8月14 日	2021年2月 25日	新发流通 受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-	
300907	康平 科技	2020年11月 11日	2021年5月 18日	新发流通 受限	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-	
300879	大叶 股份	2020年8月25 日	2021年3月1 日	新发流通 受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-	
300911	亿田 智能	2020年11月 24日	2021年6月3 日	新发流通 受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-	
300893	松原 股份	2020年9月17 日	2021年3月 24日	新发流通 受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-	
300918	南山 智尚	2020年12月 15日	2021年6月 22日	新发流通 受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-	
300881	盛德 鑫泰	2020年8月25 日	2021年3月5 日	新发流通 受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-	
300922	天秦 装备	2020年12月 18日	2021年6月 25日	新发流通 受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-	
300917	特发 服务	2020年12月 14日	2021年6月 21日	新发流通 受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-	

605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新发流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新发流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新发流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-

#### 7.4.12.2 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
300182	捷成股份	2020年12月30日	重大事项	3.23	2021年1月7日	3.40	153,642	802,611.35	496,263.66	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；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的证券，不得超过该证券的 10%。

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

### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	51,480,153.18	-	-	-	-	-	51,480,153.18
结算备付金	13,456,694.14	-	-	-	-	-	13,456,694.14
存出保证金	75,182.39	-	-	-	-	2,826,990.00	2,902,172.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	602,987,361.70	602,987,361.70
应收利息	-	-	-	-	-	12,150.95	12,150.95
应收申购款	-	-	-	-	-	822.37	822.37
资产总计	65,012,029.71	-	-	-	-	605,827,325.02	670,839,354.73
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,937.24	3,937.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	330,221.16	330,221.16
应付托管费	-	-	-	-	-	82,555.30	82,555.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	340.68	340.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	476,665.19	476,665.19
其他负债	-	-	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,058,719.57	1,058,719.57
利率敏感度缺口	65,012,029.71	-	-	-	-	-604,768,605.45	669,780,635.16
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

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 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	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产—股票投资	602,987,361.70	90.03	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	-	-	-	-
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	602,987,361.70	90.03	429,685,726.89	92.93

#### 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%	66,966,568.58	33,400,477.49
	业绩比较基准下降 5%	-66,966,568.58	-33,400,477.49

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末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 600,266,114.72 元，属于第二层次的余额为人民币 702,864.79 元，属于第三层次的余额为 2,018,382.19 元（上年度末：第一层次人民币 423,481,415.76 元，第二层次人民币 284,902.05 元，第三层次人民币 5,919,409.08 元）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有

重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具转出第三层次公允价值的金额为人民币 75,943.00 元（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	602,987,361.70	89.89
	其中：股票	602,987,361.70	89.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	64,936,847.32	9.68
8	其他各项资产	2,915,145.71	0.43
9	合计	670,839,354.73	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	1,184,656.10	0.18
B	采矿业	6,460,240.46	0.96
C	制造业	420,236,690.55	62.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,175,313.38	1.52
E	建筑业	3,354,513.94	0.50
F	批发和零售业	10,151,231.62	1.52
G	交通运输、仓储和邮政业	13,644,584.06	2.04
H	住宿和餐饮业	1,325,178.24	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,042,708.88	5.98
J	金融业	33,989,091.68	5.07
K	房地产业	15,438,667.70	2.31
L	租赁和商务服务业	14,105,942.73	2.11
M	科学研究和技术服务业	7,433,972.26	1.11

N	水利、环境和公共设施管理业	3,298,171.18	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,561,383.86	0.38
Q	卫生和社会工作	7,155,696.96	1.07
R	文化、体育和娱乐业	11,481,503.27	1.71
S	综合	947,814.83	0.14
	合计	602,987,361.70	90.03

### 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股票投资。

### 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	601888	中国中免	33,638	9,501,053.10	1.42
2	600519	贵州茅台	4,620	9,230,760.00	1.38
3	000858	五粮液	31,379	9,157,961.15	1.37
4	300122	智飞生物	53,790	7,956,078.90	1.19
5	000568	泸州老窖	34,928	7,899,316.48	1.18
6	603658	安图生物	50,668	7,355,980.24	1.10
7	300750	宁德时代	17,435	6,121,602.85	0.91
8	600426	华鲁恒升	161,320	6,017,236.00	0.90
9	601012	隆基股份	64,286	5,927,169.20	0.88
10	300724	捷佳伟创	37,490	5,458,544.00	0.81
11	300680	隆盛科技	173,402	5,411,876.42	0.81
12	601318	中国平安	59,742	5,196,359.16	0.78
13	002821	凯莱英	16,715	5,000,125.10	0.75
14	300124	汇川技术	52,404	4,889,293.20	0.73
15	600438	通威股份	112,883	4,339,222.52	0.65
16	600390	五矿资本	619,728	4,325,701.44	0.65
17	603259	药明康德	31,815	4,286,116.80	0.64
18	300188	美亚柏科	194,310	4,185,437.40	0.62
19	300725	药石科技	29,011	4,003,518.00	0.60
20	600699	均胜电子	157,394	3,991,511.84	0.60
21	600966	博汇纸业	263,228	3,956,316.84	0.59
22	300482	万孚生物	43,700	3,898,477.00	0.58
23	000661	长春高新	8,684	3,898,334.44	0.58
24	002138	顺络电子	155,078	3,802,512.56	0.57

25	603444	吉比特	8,868	3,777,768.00	0.56
26	002078	太阳纸业	257,217	3,711,641.31	0.55
27	000719	中原传媒	541,200	3,690,984.00	0.55
28	603612	索通发展	269,981	3,690,640.27	0.55
29	600486	扬农化工	27,642	3,648,744.00	0.54
30	600309	万华化学	39,495	3,595,624.80	0.54
31	300059	东方财富	112,595	3,490,445.00	0.52
32	300395	菲利华	57,139	3,418,626.37	0.51
33	603605	珀莱雅	18,921	3,367,938.00	0.50
34	000951	中国重汽	104,300	3,281,278.00	0.49
35	600657	信达地产	809,200	3,277,260.00	0.49
36	002709	天赐材料	30,607	3,177,006.60	0.47
37	300760	迈瑞医疗	7,429	3,164,754.00	0.47
38	300037	新宙邦	30,647	3,107,605.80	0.46
39	300558	贝达药业	28,155	3,023,002.35	0.45
40	002025	航天电器	44,871	2,924,691.78	0.44
41	002157	正邦科技	169,652	2,890,870.08	0.43
42	002027	分众传媒	291,475	2,876,858.25	0.43
43	300010	豆神教育	292,500	2,854,800.00	0.43
44	002007	华兰生物	66,802	2,821,716.48	0.42
45	603816	顾家家居	38,688	2,727,890.88	0.41
46	688363	华熙生物	18,553	2,716,715.79	0.41
47	600872	中炬高新	40,529	2,701,257.85	0.40
48	002648	卫星石化	103,103	2,693,050.36	0.40
49	688016	心脉医疗	10,648	2,674,777.60	0.40
50	002311	海大集团	40,421	2,647,575.50	0.40
51	000157	中联重科	265,893	2,632,340.70	0.39
52	603517	绝味食品	33,867	2,626,047.18	0.39
53	600660	福耀玻璃	54,315	2,609,835.75	0.39
54	001896	豫能控股	270,310	2,603,085.30	0.39
55	600483	福能股份	322,400	2,556,632.00	0.38
56	300777	中简科技	49,654	2,512,988.94	0.38
57	600562	国睿科技	147,125	2,504,067.50	0.37
58	300751	迈为股份	3,698	2,503,582.98	0.37
59	002607	中公教育	71,122	2,498,515.86	0.37
60	300015	爱尔眼科	33,169	2,484,026.41	0.37
61	600104	上汽集团	101,200	2,473,328.00	0.37
62	002601	龙鳞佰利	79,900	2,458,523.00	0.37
63	603986	兆易创新	12,447	2,458,282.50	0.37



64	600782	新钢股份	531,975	2,441,765.25	0.36
65	600285	羚锐制药	286,415	2,425,935.05	0.36
66	600763	通策医疗	8,755	2,420,932.60	0.36
67	603866	桃李面包	40,640	2,401,824.00	0.36
68	601233	桐昆股份	116,016	2,388,769.44	0.36
69	002847	盐津铺子	21,600	2,380,752.00	0.36
70	300274	阳光电源	32,598	2,356,183.44	0.35
71	002422	科伦药业	120,989	2,352,026.16	0.35
72	300595	欧普康视	28,400	2,326,528.00	0.35
73	000830	鲁西化工	179,731	2,296,962.18	0.34
74	000333	美的集团	23,222	2,285,973.68	0.34
75	002777	久远银海	97,849	2,283,795.66	0.34
76	600732	爱旭股份	142,372	2,273,680.84	0.34
77	300413	芒果超媒	31,136	2,257,360.00	0.34
78	002304	洋河股份	9,342	2,204,618.58	0.33
79	600989	宝丰能源	185,762	2,173,415.40	0.32
80	300394	天孚通信	40,604	2,165,411.32	0.32
81	603288	海天味业	10,753	2,156,406.62	0.32
82	600655	豫园股份	239,013	2,124,825.57	0.32
83	002202	金风科技	148,687	2,118,789.75	0.32
84	600276	恒瑞医药	18,987	2,116,291.02	0.32
85	000960	锡业股份	188,148	2,107,257.60	0.31
86	601117	中国化学	357,933	2,101,066.71	0.31
87	002938	鹏鼎控股	41,942	2,083,259.14	0.31
88	002384	东山精密	79,455	2,065,830.00	0.31
89	002372	伟星新材	109,863	2,054,438.10	0.31
90	300078	思创医惠	221,792	2,007,217.60	0.30
91	300782	卓胜微	3,510	2,002,595.40	0.30
92	002292	奥飞娱乐	328,483	2,000,461.47	0.30
93	601111	中国国航	256,626	1,922,128.74	0.29
94	601636	旗滨集团	149,729	1,916,531.20	0.29
95	002706	良信股份	62,446	1,913,345.44	0.29
96	300770	新媒股份	27,212	1,913,003.60	0.29
97	601231	环旭电子	97,997	1,895,261.98	0.28
98	000002	万科 A	64,343	1,846,644.10	0.28
99	600887	伊利股份	41,600	1,845,792.00	0.28
100	600884	杉杉股份	102,302	1,844,505.06	0.28
101	002747	埃斯顿	61,852	1,844,426.64	0.28
102	300369	绿盟科技	118,504	1,810,741.12	0.27

103	688039	当虹科技	30,625	1,803,812.50	0.27
104	601601	中国太保	46,585	1,788,864.00	0.27
105	600803	新奥股份	130,300	1,770,777.00	0.26
106	601021	春秋航空	31,924	1,769,547.32	0.26
107	600036	招商银行	40,068	1,760,988.60	0.26
108	603678	火炬电子	24,296	1,756,600.80	0.26
109	002867	周大生	65,471	1,744,802.15	0.26
110	603786	科博达	25,678	1,736,346.36	0.26
111	600033	福建高速	653,558	1,718,857.54	0.26
112	600809	山西汾酒	4,514	1,694,059.06	0.25
113	603882	金域医学	13,124	1,681,446.88	0.25
114	601799	星宇股份	8,343	1,672,771.50	0.25
115	002429	兆驰股份	267,983	1,661,494.60	0.25
116	688111	金山办公	3,974	1,633,314.00	0.24
117	300502	新易盛	29,250	1,622,790.00	0.24
118	600048	保利地产	101,042	1,598,484.44	0.24
119	000725	京东方 A	265,454	1,592,724.00	0.24
120	002600	领益智造	131,158	1,572,584.42	0.23
121	000538	云南白药	13,700	1,556,320.00	0.23
122	000963	华东医药	58,515	1,554,158.40	0.23
123	603345	安井食品	8,041	1,550,867.67	0.23
124	000636	风华高科	45,900	1,546,830.00	0.23
125	002352	顺丰控股	17,459	1,540,407.57	0.23
126	002475	立讯精密	27,257	1,529,662.84	0.23
127	600466	蓝光发展	324,461	1,502,254.43	0.22
128	600201	生物股份	71,560	1,494,888.40	0.22
129	601211	国泰君安	83,800	1,469,014.00	0.22
130	601128	常熟银行	198,430	1,464,413.40	0.22
131	300083	创世纪	123,086	1,449,953.08	0.22
132	600346	恒力石化	51,555	1,441,993.35	0.22
133	600900	长江电力	72,291	1,385,095.56	0.21
134	600606	绿地控股	237,515	1,384,712.45	0.21
135	600845	宝信软件	20,055	1,383,393.90	0.21
136	000100	TCL 科技	194,418	1,376,479.44	0.21
137	601100	恒立液压	12,139	1,371,707.00	0.20
138	000977	浪潮信息	50,903	1,368,272.64	0.20
139	300450	先导智能	16,185	1,359,378.15	0.20
140	601995	中金公司	18,051	1,358,698.77	0.20
141	002008	大族激光	31,405	1,342,563.75	0.20

142	600623	华谊集团	227,065	1,316,977.00	0.20
143	300699	光威复材	14,704	1,309,391.20	0.20
144	300451	创业慧康	96,552	1,306,348.56	0.20
145	002100	天康生物	119,936	1,270,122.24	0.19
146	002727	一心堂	38,100	1,269,111.00	0.19
147	300773	拉卡拉	42,220	1,263,222.40	0.19
148	601225	陕西煤业	135,238	1,263,122.92	0.19
149	300737	科顺股份	57,757	1,239,465.22	0.19
150	300639	凯普生物	32,887	1,235,893.46	0.18
151	600862	中航高科	41,050	1,235,605.00	0.18
152	601689	拓普集团	32,029	1,230,874.47	0.18
153	600600	青岛啤酒	12,347	1,227,291.80	0.18
154	688095	福昕软件	5,071	1,227,182.00	0.18
155	603833	欧派家居	9,100	1,223,950.00	0.18
156	603197	保隆科技	43,210	1,215,497.30	0.18
157	000338	潍柴动力	76,873	1,213,824.67	0.18
158	603899	晨光文具	13,697	1,213,006.32	0.18
159	688122	西部超导	15,106	1,201,078.06	0.18
160	603129	春风动力	6,894	1,200,865.86	0.18
161	300628	亿联网络	16,160	1,181,619.20	0.18
162	600810	神马股份	126,395	1,174,209.55	0.18
163	600999	招商证券	50,163	1,170,804.42	0.17
164	300251	光线传媒	96,984	1,170,596.88	0.17
165	000932	华菱钢铁	243,731	1,165,034.18	0.17
166	002557	洽洽食品	21,600	1,163,160.00	0.17
167	300661	圣邦股份	4,338	1,144,364.40	0.17
168	601222	林洋能源	143,800	1,138,896.00	0.17
169	000671	阳光城	174,000	1,134,480.00	0.17
170	000799	酒鬼酒	7,200	1,126,800.00	0.17
171	603338	浙江鼎力	11,088	1,121,994.72	0.17
172	002120	韵达股份	71,400	1,120,980.00	0.17
173	300759	康龙化成	9,303	1,120,081.20	0.17
174	300601	康泰生物	6,376	1,112,612.00	0.17
175	600030	中信证券	37,691	1,108,115.40	0.17
176	601166	兴业银行	52,407	1,093,734.09	0.16
177	002036	联创电子	105,334	1,089,153.56	0.16
178	600009	上海机场	14,366	1,086,931.56	0.16
179	600742	一汽富维	108,195	1,086,277.80	0.16
180	603416	信捷电气	11,797	1,071,639.48	0.16

181	002153	石基信息	34,425	1,070,273.25	0.16
182	002714	牧原股份	13,781	1,062,515.10	0.16
183	002891	中宠股份	18,430	1,059,540.70	0.16
184	603043	广州酒家	26,445	1,024,214.85	0.15
185	600741	华域汽车	35,343	1,018,585.26	0.15
186	603707	健友股份	28,961	1,017,399.93	0.15
187	300308	中际旭创	19,914	1,012,826.04	0.15
188	600894	广日股份	124,900	1,009,192.00	0.15
189	600690	海尔智家	34,436	1,005,875.56	0.15
190	600163	中闽能源	240,250	994,635.00	0.15
191	603501	韦尔股份	4,298	993,267.80	0.15
192	600985	淮北矿业	87,787	982,336.53	0.15
193	300679	电连技术	28,630	972,561.10	0.15
194	600567	山鹰国际	321,289	970,292.78	0.14
195	000651	格力电器	15,628	967,998.32	0.14
196	002841	视源股份	8,400	966,252.00	0.14
197	002410	广联达	12,132	955,273.68	0.14
198	300529	健帆生物	14,072	954,363.04	0.14
199	300487	蓝晓科技	20,888	929,516.00	0.14
200	300747	锐科激光	10,418	915,325.48	0.14
201	300775	三角防务	23,038	908,157.96	0.14
202	300142	沃森生物	23,500	906,160.00	0.14
203	603883	老百姓	14,400	904,752.00	0.14
204	600570	恒生电子	8,586	900,671.40	0.13
205	600373	中文传媒	88,915	897,152.35	0.13
206	300144	宋城演艺	50,082	887,453.04	0.13
207	002139	拓邦股份	109,400	887,234.00	0.13
208	300740	御家汇	48,802	883,316.20	0.13
209	600711	盛屯矿业	96,394	882,969.04	0.13
210	600383	金地集团	63,766	860,841.00	0.13
211	002353	杰瑞股份	24,515	858,025.00	0.13
212	600185	格力地产	130,630	843,869.80	0.13
213	601326	秦港股份	296,757	836,854.74	0.12
214	688008	澜起科技	10,008	829,463.04	0.12
215	002540	亚太科技	158,988	826,737.60	0.12
216	601966	玲珑轮胎	23,500	826,495.00	0.12
217	688396	华润微	12,876	804,621.24	0.12
218	002142	宁波银行	22,593	798,436.62	0.12
219	603659	璞泰来	7,083	796,058.37	0.12

220	000786	北新建材	19,800	792,990.00	0.12
221	601336	新华保险	13,447	779,522.59	0.12
222	600031	三一重工	22,165	775,331.70	0.12
223	002034	旺能环境	48,626	774,125.92	0.12
224	300496	中科创达	6,600	772,200.00	0.12
225	300316	晶盛机电	25,615	770,499.20	0.12
226	605009	豪悦护理	4,010	763,103.00	0.11
227	300012	华测检测	27,838	761,926.06	0.11
228	000921	海信家电	52,738	759,954.58	0.11
229	600258	首旅酒店	35,360	750,339.20	0.11
230	601058	赛轮轮胎	124,000	748,960.00	0.11
231	603010	万盛股份	33,327	743,192.10	0.11
232	300266	兴源环境	220,627	739,100.45	0.11
233	603218	日月股份	24,373	737,283.25	0.11
234	002906	华阳集团	27,300	736,008.00	0.11
235	600026	中远海能	110,019	734,926.92	0.11
236	603233	大参林	9,300	728,655.00	0.11
237	002705	新宝股份	16,989	717,785.25	0.11
238	000063	中兴通讯	21,300	716,745.00	0.11
239	300408	三环集团	19,200	715,200.00	0.11
240	002487	大金重工	78,000	709,020.00	0.11
241	300101	振芯科技	43,400	699,608.00	0.10
242	002550	千红制药	164,608	699,584.00	0.10
243	002831	裕同科技	22,770	697,217.40	0.10
244	002460	赣锋锂业	6,871	695,345.20	0.10
245	002080	中材科技	28,740	694,933.20	0.10
246	300315	掌趣科技	135,623	693,033.53	0.10
247	688018	乐鑫科技	4,632	688,454.16	0.10
248	000733	振华科技	11,670	686,779.50	0.10
249	300896	爱美客	1,065	685,611.18	0.10
250	000009	中国宝安	91,011	685,312.83	0.10
251	000401	冀东水泥	48,400	684,860.00	0.10
252	300696	爱乐达	12,373	676,184.45	0.10
253	000783	长江证券	80,000	672,000.00	0.10
254	002409	雅克科技	11,100	666,999.00	0.10
255	002385	大北农	67,883	655,749.78	0.10
256	688063	派能科技	3,437	650,417.88	0.10
257	300433	蓝思科技	21,107	646,085.27	0.10
258	601899	紫金矿业	68,704	638,260.16	0.10

259	603317	天味食品	7,700	633,248.00	0.09
260	002851	麦格米特	18,523	630,893.38	0.09
261	300792	壹网壹创	5,646	623,374.86	0.09
262	600126	杭钢股份	117,508	621,617.32	0.09
263	000001	平安银行	32,072	620,272.48	0.09
264	000553	安道麦 A	78,841	616,536.62	0.09
265	601985	中国核电	125,031	615,152.52	0.09
266	688526	科前生物	14,675	610,480.00	0.09
267	600109	国金证券	37,484	609,864.68	0.09
268	601088	中国神华	33,773	608,251.73	0.09
269	600223	鲁商发展	70,548	601,068.96	0.09
270	000513	丽珠集团	14,500	587,250.00	0.09
271	300002	神州泰岳	113,900	582,029.00	0.09
272	603881	数据港	9,572	575,372.92	0.09
273	603323	苏农银行	114,600	568,416.00	0.08
274	600757	长江传媒	107,100	566,559.00	0.08
275	002609	捷顺科技	60,178	560,257.18	0.08
276	600153	建发股份	67,800	556,638.00	0.08
277	002585	双星新材	55,200	555,312.00	0.08
278	601168	西部矿业	44,800	554,624.00	0.08
279	601900	南方传媒	66,589	551,356.92	0.08
280	300219	鸿利智汇	49,700	547,197.00	0.08
281	002614	奥佳华	40,591	545,948.95	0.08
282	600998	九州通	30,054	545,780.64	0.08
283	600643	爱建集团	72,077	542,019.04	0.08
284	002298	中电兴发	57,900	540,207.00	0.08
285	300014	亿纬锂能	6,588	536,922.00	0.08
286	002791	坚朗五金	3,713	534,672.00	0.08
287	600478	科力远	108,668	532,473.20	0.08
288	002594	比亚迪	2,726	529,661.80	0.08
289	600429	三元股份	106,432	528,967.04	0.08
290	002508	老板电器	12,720	518,721.60	0.08
291	601328	交通银行	115,506	517,466.88	0.08
292	002158	汉钟精机	34,276	516,882.08	0.08
293	600901	江苏租赁	93,400	514,634.00	0.08
294	002920	德赛西威	6,100	513,254.00	0.08
295	601872	招商轮船	90,464	511,121.60	0.08
296	600521	华海药业	15,000	507,150.00	0.08
297	600138	中青旅	48,550	498,123.00	0.07

298	300182	捷成股份	153,642	496,263.66	0.07
299	300058	蓝色光标	81,585	489,510.00	0.07
300	600339	中油工程	158,376	487,798.08	0.07
301	002332	仙琚制药	36,097	482,255.92	0.07
302	300659	中孚信息	9,600	471,168.00	0.07
303	600622	光大嘉宝	138,649	468,633.62	0.07
304	002064	华峰氨纶	46,327	467,439.43	0.07
305	600502	安徽建工	123,226	465,794.28	0.07
306	002415	海康威视	9,600	465,696.00	0.07
307	002690	美亚光电	10,399	460,467.72	0.07
308	601688	华泰证券	25,431	458,012.31	0.07
309	300119	瑞普生物	24,030	453,686.40	0.07
310	002812	恩捷股份	3,159	447,883.02	0.07
311	603520	司太立	6,800	447,644.00	0.07
312	603638	艾迪精密	6,400	441,216.00	0.07
313	601997	贵阳银行	55,309	439,706.55	0.07
314	002033	丽江股份	68,483	438,291.20	0.07
315	000596	古井贡酒	1,600	435,200.00	0.06
316	600708	光明地产	170,206	434,025.30	0.06
317	600885	宏发股份	7,898	428,229.56	0.06
318	300253	卫宁健康	24,382	426,685.00	0.06
319	300136	信维通信	11,888	426,541.44	0.06
320	600996	贵广网络	76,904	419,895.84	0.06
321	300726	宏达电子	5,800	419,630.00	0.06
322	300548	博创科技	12,009	416,111.85	0.06
323	688169	石头科技	400	414,400.00	0.06
324	000516	国际医学	32,600	409,782.00	0.06
325	002555	三七互娱	12,954	404,553.42	0.06
326	002171	楚江新材	47,162	402,763.48	0.06
327	300685	艾德生物	5,089	398,214.25	0.06
328	600636	国新文化	29,600	397,232.00	0.06
329	600754	锦江酒店	7,568	389,979.04	0.06
330	002572	索菲亚	14,945	387,075.50	0.06
331	002925	盈趣科技	6,014	386,880.62	0.06
332	601865	福莱特	9,688	386,551.20	0.06
333	002612	朗姿股份	15,548	382,947.24	0.06
334	603198	迎驾贡酒	10,800	376,920.00	0.06
335	600801	华新水泥	18,216	375,796.08	0.06
336	603787	新日股份	12,386	366,501.74	0.05

337	603669	灵康药业	42,300	364,626.00	0.05
338	002277	友阿股份	98,783	363,521.44	0.05
339	603566	普莱柯	17,381	360,308.13	0.05
340	601949	中国出版	62,708	354,300.20	0.05
341	603027	千禾味业	9,460	353,614.80	0.05
342	600019	宝钢股份	58,500	348,075.00	0.05
343	603686	龙马环卫	21,600	347,328.00	0.05
344	002588	史丹利	59,800	343,252.00	0.05
345	000976	华铁股份	64,680	342,804.00	0.05
346	600315	上海家化	9,840	341,743.20	0.05
347	001979	招商蛇口	25,500	338,895.00	0.05
348	601818	光大银行	84,561	337,398.39	0.05
349	601919	中远海控	27,500	335,775.00	0.05
350	300192	科德教育	22,100	332,163.00	0.05
351	000589	贵州轮胎	50,000	329,000.00	0.05
352	600305	恒顺醋业	14,566	322,491.24	0.05
353	300019	硅宝科技	18,500	319,865.00	0.05
354	002414	高德红外	7,600	317,300.00	0.05
355	603568	伟明环保	16,600	314,238.00	0.05
356	300383	光环新网	17,984	308,785.28	0.05
357	000423	东阿阿胶	7,933	307,086.43	0.05
358	600161	天坛生物	7,289	303,951.30	0.05
359	600061	国投资本	21,900	302,877.00	0.05
360	002402	和而泰	17,424	300,912.48	0.04
361	600038	中直股份	4,783	299,941.93	0.04
362	002563	森马服饰	29,892	299,517.84	0.04
363	002419	天虹股份	39,165	299,220.60	0.04
364	601939	建设银行	47,400	297,672.00	0.04
365	000895	双汇发展	6,300	295,722.00	0.04
366	600051	宁波联合	33,164	295,491.24	0.04
367	600958	东方证券	25,100	291,913.00	0.04
368	603383	顶点软件	9,166	288,454.02	0.04
369	300653	正海生物	5,077	287,510.51	0.04
370	002641	永高股份	45,000	287,100.00	0.04
371	002371	北方华创	1,586	286,653.64	0.04
372	600063	皖维高新	78,094	285,824.04	0.04
373	002624	完美世界	9,648	284,616.00	0.04
374	000776	广发证券	17,300	281,644.00	0.04
375	002335	科华恒盛	12,600	281,484.00	0.04



376	002739	万达电影	15,514	280,493.12	0.04
377	000937	冀中能源	67,100	279,136.00	0.04
378	002233	塔牌集团	21,805	277,795.70	0.04
379	600588	用友网络	6,286	275,766.82	0.04
380	600468	百利电气	62,309	274,782.69	0.04
381	600027	华电国际	80,800	274,720.00	0.04
382	300999	金龙鱼	3,104	274,052.16	0.04
383	600067	冠城大通	74,720	272,728.00	0.04
384	300378	鼎捷软件	10,000	272,500.00	0.04
385	603060	国检集团	13,800	269,928.00	0.04
386	600563	法拉电子	2,500	268,875.00	0.04
387	600195	中牧股份	20,900	267,729.00	0.04
388	600436	片仔癀	993	265,637.43	0.04
389	000883	湖北能源	68,100	264,228.00	0.04
390	002050	三花智控	10,568	260,501.20	0.04
391	603806	福斯特	3,005	256,627.00	0.04
392	600703	三安光电	9,400	253,894.00	0.04
393	603516	淳中科技	7,774	251,100.20	0.04
394	603587	地素时尚	13,145	250,675.15	0.04
395	002308	威创股份	49,803	250,011.06	0.04
396	002815	崇达技术	17,249	249,075.56	0.04
397	002773	康弘药业	5,162	248,550.30	0.04
398	603515	欧普照明	8,200	247,722.00	0.04
399	603359	东珠生态	15,403	246,293.97	0.04
400	300020	银江股份	29,700	245,025.00	0.04
401	002148	北纬科技	55,973	244,042.28	0.04
402	603018	华设集团	22,200	243,090.00	0.04
403	300206	理邦仪器	13,300	242,725.00	0.04
404	600575	淮河能源	104,146	241,618.72	0.04
405	600377	宁沪高速	26,200	241,302.00	0.04
406	601952	苏垦农发	17,158	241,241.48	0.04
407	300638	广和通	4,010	239,998.50	0.04
408	002970	锐明技术	4,500	238,545.00	0.04
409	603983	丸美股份	4,558	237,973.18	0.04
410	300009	安科生物	16,205	237,889.40	0.04
411	600475	华光环能	20,800	237,120.00	0.04
412	600028	中国石化	58,300	234,949.00	0.04
413	300567	精测电子	4,272	234,703.68	0.04
414	002381	双箭股份	28,147	234,464.51	0.04

415	603877	太平鸟	7,800	234,000.00	0.03
416	002110	三钢闽光	34,700	233,531.00	0.03
417	603179	新泉股份	6,859	232,520.10	0.03
418	300132	青松股份	12,300	231,117.00	0.03
419	000900	现代投资	54,255	230,583.75	0.03
420	002493	荣盛石化	8,347	230,460.67	0.03
421	002320	海峡股份	25,002	227,768.22	0.03
422	002444	巨星科技	7,300	227,103.00	0.03
423	601009	南京银行	27,793	224,567.44	0.03
424	002054	德美化工	27,432	223,570.80	0.03
425	601169	北京银行	46,000	222,640.00	0.03
426	600125	铁龙物流	36,878	222,005.56	0.03
427	600079	人福医药	6,500	220,220.00	0.03
428	300223	北京君正	2,400	219,576.00	0.03
429	603458	勘设股份	15,300	218,637.00	0.03
430	300391	康跃科技	17,795	218,344.65	0.03
431	603160	汇顶科技	1,400	217,770.00	0.03
432	601126	四方股份	31,200	217,152.00	0.03
433	600278	东方创业	25,076	216,907.40	0.03
434	603788	宁波高发	15,520	216,038.40	0.03
435	300415	伊之密	16,127	215,940.53	0.03
436	603869	新智认知	22,000	214,500.00	0.03
437	300114	中航电测	14,309	213,919.55	0.03
438	000690	宝新能源	29,204	213,189.20	0.03
439	300533	冰川网络	8,613	212,568.84	0.03
440	000902	新洋丰	13,238	211,808.00	0.03
441	600022	山东钢铁	148,047	211,707.21	0.03
442	600269	赣粤高速	61,800	211,356.00	0.03
443	300501	海顺新材	11,800	210,630.00	0.03
444	002124	天邦股份	14,300	208,780.00	0.03
445	002434	万里扬	23,200	206,944.00	0.03
446	688330	宏力达	2,712	205,759.44	0.03
447	600141	兴发集团	18,314	202,003.42	0.03
448	002734	利民股份	15,835	201,262.85	0.03
449	603626	科森科技	17,443	200,768.93	0.03
450	600323	瀚蓝环境	8,084	200,564.04	0.03
451	600115	东方航空	42,500	198,900.00	0.03
452	300454	深信服	800	198,408.00	0.03
453	000546	金圆股份	26,315	197,888.80	0.03

454	000045	深纺织 A	27,300	195,741.00	0.03
455	600155	华创阳安	14,800	195,212.00	0.03
456	601390	中国中铁	37,000	194,990.00	0.03
457	000630	铜陵有色	74,960	192,647.20	0.03
458	002344	海宁皮城	47,100	192,639.00	0.03
459	002532	天山铝业	25,200	190,764.00	0.03
460	002179	中航光电	2,435	190,636.15	0.03
461	000906	浙商中拓	28,400	189,712.00	0.03
462	002439	启明星辰	6,431	187,849.51	0.03
463	300673	佩蒂股份	5,978	187,051.62	0.03
464	603337	杰克股份	6,089	185,227.38	0.03
465	601007	金陵饭店	23,400	184,860.00	0.03
466	300285	国瓷材料	4,052	182,785.72	0.03
467	002399	海普瑞	10,600	182,532.00	0.03
468	002651	利君股份	15,800	182,332.00	0.03
469	603313	梦百合	5,600	181,552.00	0.03
470	603195	公牛集团	876	179,834.04	0.03
471	002301	齐心集团	13,461	179,569.74	0.03
472	002002	鸿达兴业	59,000	177,000.00	0.03
473	688012	中微公司	1,100	173,349.00	0.03
474	600919	江苏银行	31,666	172,896.36	0.03
475	000723	美锦能源	25,851	172,684.68	0.03
476	000049	德赛电池	2,544	171,974.40	0.03
477	002127	南极电商	12,102	165,555.36	0.02
478	002315	焦点科技	9,900	163,548.00	0.02
479	600231	凌钢股份	65,100	163,401.00	0.02
480	002183	怡亚通	37,392	163,029.12	0.02
481	000969	安泰科技	24,600	162,852.00	0.02
482	300573	兴齐眼药	1,700	161,891.00	0.02
483	000739	普洛药业	6,900	160,632.00	0.02
484	600322	天房发展	68,300	159,822.00	0.02
485	300347	泰格医药	987	159,509.07	0.02
486	002516	旷达科技	45,400	158,900.00	0.02
487	600422	昆药集团	18,254	157,897.10	0.02
488	600765	中航重机	6,300	157,500.00	0.02
489	002421	达实智能	43,900	157,162.00	0.02
490	000050	深天马 A	10,600	156,244.00	0.02
491	002793	罗欣药业	15,000	155,550.00	0.02
492	300662	科锐国际	2,839	153,589.90	0.02

493	601717	郑煤机	13,900	151,927.00	0.02
494	002541	鸿路钢构	4,147	151,489.91	0.02
495	600814	杭州解百	27,096	151,466.64	0.02
496	300379	东方通	3,300	150,810.00	0.02
497	002317	众生药业	13,680	150,753.60	0.02
498	600808	马钢股份	56,500	150,290.00	0.02
499	002262	恩华药业	9,400	150,118.00	0.02
500	601288	农业银行	47,800	150,092.00	0.02
501	600008	首创股份	53,000	149,990.00	0.02
502	603308	应流股份	5,000	148,500.00	0.02
503	002595	豪迈科技	5,000	148,250.00	0.02
504	000975	银泰黄金	17,200	148,092.00	0.02
505	002038	双鹭药业	14,600	147,460.00	0.02
506	603208	江山欧派	1,400	147,350.00	0.02
507	601933	永辉超市	20,484	147,075.12	0.02
508	601968	宝钢包装	18,000	145,800.00	0.02
509	002649	博彦科技	15,973	143,916.73	0.02
510	002416	爱施德	19,052	142,127.92	0.02
511	002382	蓝帆医疗	6,700	141,303.00	0.02
512	002756	永兴材料	2,600	140,972.00	0.02
513	600330	天通股份	13,800	139,656.00	0.02
514	600620	天宸股份	22,600	139,442.00	0.02
515	002967	广电计量	3,800	139,270.00	0.02
516	603583	捷昌驱动	1,800	139,050.00	0.02
517	002091	江苏国泰	19,197	138,794.31	0.02
518	002056	横店东磁	9,100	138,229.00	0.02
519	600755	厦门国贸	20,600	137,608.00	0.02
520	300633	开立医疗	5,309	137,290.74	0.02
521	600582	天地科技	44,200	136,136.00	0.02
522	601857	中国石油	32,700	135,705.00	0.02
523	300463	迈克生物	2,900	135,140.00	0.02
524	002266	浙富控股	30,000	135,000.00	0.02
525	600409	三友化工	13,112	134,398.00	0.02
526	300666	江丰电子	2,700	133,677.00	0.02
527	002032	苏泊尔	1,700	132,583.00	0.02
528	600378	昊华科技	6,289	132,131.89	0.02
529	300832	新产业	1,000	132,060.00	0.02
530	600066	宇通客车	7,800	131,976.00	0.02
531	603898	好莱客	8,109	130,717.08	0.02

532	002467	二六三	22,000	130,680.00	0.02
533	603661	恒林股份	2,400	130,416.00	0.02
534	600800	天津磁卡	27,800	129,548.00	0.02
535	300525	博思软件	4,500	129,150.00	0.02
536	600075	新疆天业	22,700	128,255.00	0.02
537	603630	拉芳家化	7,900	127,664.00	0.02
538	002605	姚记科技	5,200	127,608.00	0.02
539	002215	诺普信	21,300	127,374.00	0.02
540	000959	首钢股份	33,200	127,156.00	0.02
541	002287	奇正藏药	4,900	127,057.00	0.02
542	300215	电科院	17,600	126,368.00	0.02
543	300336	新文化	38,917	125,701.91	0.02
544	002732	燕塘乳业	5,600	125,216.00	0.02
545	002959	小熊电器	1,100	124,685.00	0.02
546	300559	佳发教育	9,300	124,620.00	0.02
547	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
548	603993	洛阳钼业	19,900	124,375.00	0.02
549	002222	福晶科技	9,000	123,930.00	0.02
550	603968	醋化股份	7,400	123,654.00	0.02
551	000532	华金资本	10,500	123,060.00	0.02
552	300390	天华超净	5,000	123,000.00	0.02
553	601198	东兴证券	9,200	122,544.00	0.02
554	000885	城发环境	10,500	122,430.00	0.02
555	002362	汉王科技	5,000	122,200.00	0.02
556	300498	温氏股份	6,700	122,141.00	0.02
557	600826	兰生股份	14,400	122,112.00	0.02
558	002431	棕榈股份	38,120	121,984.00	0.02
559	002608	江苏国信	15,900	121,953.00	0.02
560	600368	五洲交通	33,300	121,878.00	0.02
561	600637	东方明珠	13,600	121,584.00	0.02
562	002534	杭锅股份	13,200	121,572.00	0.02
563	000876	新希望	5,400	120,960.00	0.02
564	600131	国网信通	8,500	120,955.00	0.02
565	300642	透景生命	2,100	120,540.00	0.02
566	300146	汤臣倍健	4,991	120,532.65	0.02
567	600011	华能国际	26,831	120,202.88	0.02
568	600556	天下秀	9,500	120,175.00	0.02
569	600170	上海建工	39,900	120,099.00	0.02
570	000166	申万宏源	22,700	119,856.00	0.02

571	002398	垒知集团	15,400	119,812.00	0.02
572	603606	东方电缆	4,800	119,760.00	0.02
573	600007	中国国贸	9,600	119,520.00	0.02
574	002111	威海广泰	7,800	119,028.00	0.02
575	601727	上海电气	22,000	118,800.00	0.02
576	300684	中石科技	5,200	118,768.00	0.02
577	600210	紫江企业	27,300	118,755.00	0.02
578	300788	中信出版	2,800	118,748.00	0.02
579	000600	建投能源	21,100	118,371.00	0.02
580	603500	祥和实业	10,430	118,171.90	0.02
581	601377	兴业证券	13,600	118,048.00	0.02
582	002632	道明光学	15,900	117,978.00	0.02
583	002677	浙江美大	7,400	117,882.00	0.02
584	000708	中信特钢	5,400	117,666.00	0.02
585	601158	重庆水务	22,800	116,736.00	0.02
586	688004	博汇科技	2,500	116,725.00	0.02
587	300016	北陆药业	12,204	116,670.24	0.02
588	300676	华大基因	900	115,704.00	0.02
589	600025	华能水电	25,900	115,514.00	0.02
590	601212	白银有色	39,000	115,440.00	0.02
591	600750	江中药业	10,801	114,598.61	0.02
592	002241	歌尔股份	3,067	114,460.44	0.02
593	600167	联美控股	10,000	113,500.00	0.02
594	600023	浙能电力	30,900	112,167.00	0.02
595	603298	杭叉集团	5,300	111,353.00	0.02
596	603886	元祖股份	6,519	111,083.76	0.02
597	601996	丰林集团	36,900	110,700.00	0.02
598	000631	顺发恒业	36,353	110,513.12	0.02
599	300233	金城医药	5,700	108,585.00	0.02
600	002271	东方雨虹	2,748	106,622.40	0.02
601	000069	华侨城 A	15,000	106,350.00	0.02
602	300888	稳健医疗	638	105,908.00	0.02
603	600984	建设机械	8,500	104,975.00	0.02
604	600795	国电电力	46,600	104,850.00	0.02
605	000656	金科股份	14,765	104,683.85	0.02
606	601003	柳钢股份	19,800	102,762.00	0.02
607	600597	光明乳业	6,282	102,145.32	0.02
608	300043	星辉娱乐	29,800	101,916.00	0.02
609	600837	海通证券	7,848	100,925.28	0.02

610	601066	中信建投	2,400	100,800.00	0.02
611	002293	罗莱生活	7,974	99,276.30	0.01
612	603166	福达股份	16,700	99,031.00	0.01
613	002254	泰和新材	6,417	98,115.93	0.01
614	601186	中国铁建	12,400	97,960.00	0.01
615	300869	康泰医学	872	96,768.06	0.01
616	000554	泰山石油	21,900	96,579.00	0.01
617	002832	比音勒芬	5,939	96,449.36	0.01
618	002049	紫光国微	713	95,406.53	0.01
619	002432	九安医疗	10,200	94,146.00	0.01
620	600512	腾达建设	31,600	93,536.00	0.01
621	000961	中南建设	10,473	92,476.59	0.01
622	300572	安车检测	2,197	89,813.36	0.01
623	601038	一拖股份	7,280	88,597.60	0.01
624	600779	水井坊	1,062	88,167.24	0.01
625	600571	信雅达	11,600	87,928.00	0.01
626	603486	科沃斯	970	85,835.30	0.01
627	600997	开滦股份	14,941	85,761.34	0.01
628	002845	同兴达	3,124	84,410.48	0.01
629	600546	山煤国际	9,862	83,925.62	0.01
630	603937	丽岛新材	8,400	83,328.00	0.01
631	002325	洪涛股份	31,900	82,940.00	0.01
632	300674	宇信科技	2,427	82,348.11	0.01
633	002829	星网宇达	1,900	82,042.00	0.01
634	600380	健康元	5,868	81,623.88	0.01
635	300270	中威电子	13,900	81,593.00	0.01
636	002073	软控股份	17,367	81,277.56	0.01
637	300168	万达信息	3,732	80,947.08	0.01
638	600718	东软集团	7,720	80,365.20	0.01
639	300302	同有科技	7,100	80,088.00	0.01
640	300512	中亚股份	7,000	80,010.00	0.01
641	600363	联创光电	3,231	79,579.53	0.01
642	600745	闻泰科技	800	79,200.00	0.01
643	600577	精达股份	25,133	78,163.63	0.01
644	300073	当升科技	1,204	78,079.40	0.01
645	300289	利德曼	13,253	78,060.17	0.01
646	002283	天润工业	14,400	77,472.00	0.01
647	603699	纽威股份	6,149	76,801.01	0.01
648	600298	安琪酵母	1,500	76,605.00	0.01

649	603766	隆鑫通用	21,761	76,163.50	0.01
650	000928	中钢国际	17,111	76,143.95	0.01
651	688536	思瑞浦	175	75,600.00	0.01
652	002216	三全食品	2,900	75,255.00	0.01
653	002949	华阳国际	4,000	75,000.00	0.01
654	000539	粤电力 A	19,159	74,336.92	0.01
655	300207	欣旺达	2,400	73,704.00	0.01
656	600029	南方航空	11,900	70,924.00	0.01
657	002838	道恩股份	2,700	69,498.00	0.01
658	600233	圆通速递	6,000	69,000.00	0.01
659	600854	春兰股份	18,200	68,796.00	0.01
660	600004	白云机场	4,800	67,824.00	0.01
661	600287	江苏舜天	10,700	66,447.00	0.01
662	002022	科华生物	4,300	66,306.00	0.01
663	002454	松芝股份	11,100	66,267.00	0.01
664	002133	广宇集团	21,370	65,605.90	0.01
665	300280	紫天科技	1,300	65,585.00	0.01
666	002250	联化科技	2,700	64,773.00	0.01
667	601838	成都银行	6,034	64,382.78	0.01
668	603613	国联股份	500	64,040.00	0.01
669	002491	通鼎互联	15,640	63,811.20	0.01
670	601658	邮储银行	13,300	63,574.00	0.01
671	002430	杭氧股份	2,177	63,328.93	0.01
672	600583	海油工程	14,100	63,309.00	0.01
673	000526	紫光学大	1,200	62,868.00	0.01
674	601965	中国汽研	4,200	62,202.00	0.01
675	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.01
676	002643	万润股份	2,800	60,956.00	0.01
677	002438	江苏神通	4,553	60,737.02	0.01
678	688308	欧科亿	2,457	57,518.37	0.01
679	600988	赤峰黄金	3,200	57,312.00	0.01
680	600183	生益科技	2,000	56,320.00	0.01
681	603236	移远通信	300	56,082.00	0.01
682	002314	南山控股	13,500	55,890.00	0.01
683	000619	海螺型材	9,100	54,691.00	0.01
684	002146	荣盛发展	7,800	50,934.00	0.01
685	600783	鲁信创投	3,200	47,456.00	0.01
686	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
687	300861	美畅股份	727	37,160.25	0.01



688	300027	华谊兄弟	8,600	36,980.00	0.01
689	003022	联泓新科	2,304	35,665.92	0.01
690	002324	普利特	2,040	34,557.60	0.01
691	300919	中伟股份	537	33,030.87	0.00
692	300870	欧陆通	485	31,870.53	0.00
693	300860	锋尚文化	250	31,679.59	0.00
694	603378	亚士创能	700	29,897.00	0.00
695	002868	绿康生化	2,200	29,348.00	0.00
696	300877	金春股份	576	29,303.88	0.00
697	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
698	600000	浦发银行	2,800	27,104.00	0.00
699	300868	杰美特	595	25,754.34	0.00
700	002318	久立特材	2,200	23,980.00	0.00
701	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
702	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
703	601000	唐山港	8,500	21,080.00	0.00
704	300873	海晨股份	493	20,382.82	0.00
705	300878	维康药业	406	19,788.17	0.00
706	002497	雅化集团	900	19,755.00	0.00
707	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
708	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
709	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
710	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
711	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
712	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
713	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
714	002343	慈文传媒	2,465	15,874.60	0.00
715	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
716	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
717	300864	南大环境	171	15,548.80	0.00
718	605377	华旺科技	750	14,977.50	0.00
719	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
720	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
721	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
722	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
723	300876	蒙泰高新	355	13,008.50	0.00
724	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
725	300879	大叶股份	470	12,750.72	0.00
726	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00

727	003025	思进智能	305	10,763.45	0.00
728	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
729	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
730	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
731	300881	盛德鑫泰	296	9,575.26	0.00
732	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
733	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
734	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
735	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
736	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
737	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300724	捷佳伟创	18,140,294.95	3.92
2	300770	新媒股份	17,346,850.84	3.75
3	600872	中炬高新	16,589,968.30	3.59
4	600845	宝信软件	16,139,010.06	3.49
5	002439	启明星辰	16,104,785.29	3.48
6	603517	绝味食品	15,848,026.19	3.43
7	002821	凯莱英	15,644,089.70	3.38
8	600763	通策医疗	15,436,031.21	3.34
9	000807	云铝股份	15,184,427.00	3.28
10	002648	卫星石化	15,176,681.29	3.28
11	600438	通威股份	15,102,562.12	3.27
12	300251	光线传媒	14,854,411.92	3.21
13	600426	华鲁恒升	14,810,896.19	3.20
14	600519	贵州茅台	14,748,100.55	3.19
15	300188	美亚柏科	14,601,579.36	3.16
16	600782	新钢股份	14,362,021.50	3.11
17	600201	生物股份	14,331,143.24	3.10
18	002138	顺络电子	14,331,066.85	3.10
19	601168	西部矿业	14,148,184.51	3.06

20	002100	天康生物	14,142,834.67	3.06
21	002371	北方华创	13,978,261.00	3.02
22	000625	长安汽车	13,736,100.03	2.97
23	300558	贝达药业	13,682,801.00	2.96
24	000898	鞍钢股份	13,573,349.14	2.94
25	000513	丽珠集团	13,341,688.63	2.89
26	002557	洽洽食品	13,215,393.65	2.86
27	300315	掌趣科技	13,016,726.50	2.82
28	000858	五粮液	13,009,322.67	2.81
29	601318	中国平安	12,991,815.52	2.81
30	300482	万孚生物	12,964,354.97	2.80
31	300725	药石科技	12,942,265.35	2.80
32	002025	航天电器	12,837,662.39	2.78
33	600276	恒瑞医药	12,632,960.09	2.73
34	600486	扬农化工	12,508,773.23	2.71
35	601231	环旭电子	12,415,593.06	2.69
36	002531	天顺风能	12,394,542.20	2.68
37	600161	天坛生物	12,380,898.26	2.68
38	600764	中国海防	12,342,933.00	2.67
39	300122	智飞生物	12,282,796.40	2.66
40	300308	中际旭创	12,252,807.00	2.65
41	603658	安图生物	12,128,304.80	2.62
42	300014	亿纬锂能	12,115,777.02	2.62
43	603866	桃李面包	11,848,906.22	2.56
44	600390	五矿资本	11,785,172.40	2.55
45	300455	康拓红外	11,747,075.98	2.54
46	603986	兆易创新	11,707,976.19	2.53
47	002008	大族激光	11,703,295.00	2.53
48	601677	明泰铝业	11,557,125.24	2.50
49	000503	国新健康	11,554,586.60	2.50
50	600036	招商银行	11,233,349.28	2.43
51	002078	太阳纸业	11,210,900.63	2.42
52	002773	康弘药业	11,207,871.20	2.42
53	002643	万润股份	11,165,725.80	2.41
54	300476	胜宏科技	11,149,703.34	2.41
55	600562	国睿科技	11,028,527.61	2.39

56	601233	桐昆股份	10,859,845.85	2.35
57	603444	吉比特	10,849,756.00	2.35
58	300357	我武生物	10,715,999.22	2.32
59	002597	金禾实业	10,668,817.92	2.31
60	600058	五矿发展	10,542,124.00	2.28
61	002127	南极电商	10,538,930.62	2.28
62	600657	信达地产	10,537,121.94	2.28
63	603338	浙江鼎力	10,536,718.76	2.28
64	002157	正邦科技	10,389,861.89	2.25
65	601888	中国中免	10,118,406.21	2.19
66	300253	卫宁健康	10,103,891.50	2.19
67	300347	泰格医药	10,043,902.88	2.17
68	600570	恒生电子	10,037,021.00	2.17
69	002410	广联达	10,008,725.26	2.16
70	000539	粤电力 A	9,966,922.58	2.16
71	002459	晶澳科技	9,813,136.00	2.12
72	300782	卓胜微	9,747,047.60	2.11
73	603882	金域医学	9,733,214.28	2.11
74	000728	国元证券	9,573,608.54	2.07
75	300573	兴齐眼药	9,447,558.00	2.04
76	002153	石基信息	9,446,712.09	2.04
77	300474	景嘉微	9,430,277.42	2.04
78	300010	豆神教育	9,296,152.01	2.01

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 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	000807	云铝股份	20,772,962.45	4.49
2	002821	凯莱英	20,069,979.72	4.34
3	300253	卫宁健康	19,777,221.77	4.28
4	603444	吉比特	18,022,150.16	3.90
5	600745	闻泰科技	17,339,322.01	3.75
6	600845	宝信软件	17,005,061.92	3.68
7	600872	中炬高新	16,908,771.38	3.66
8	601168	西部矿业	16,384,176.76	3.54

9	600763	通策医疗	16,275,584.69	3.52
10	603986	兆易创新	16,184,806.87	3.50
11	300724	捷佳伟创	16,050,967.50	3.47
12	002439	启明星辰	15,972,156.78	3.45
13	002371	北方华创	15,963,495.76	3.45
14	000625	长安汽车	15,801,596.52	3.42
15	603517	绝味食品	15,641,812.81	3.38
16	601689	拓普集团	15,221,879.84	3.29
17	300014	亿纬锂能	14,651,566.21	3.17
18	600161	天坛生物	14,603,564.37	3.16
19	600486	扬农化工	14,587,235.26	3.15
20	300770	新媒股份	14,467,980.24	3.13
21	600426	华鲁恒升	14,360,721.43	3.11
22	300558	贝达药业	14,312,968.62	3.10
23	300315	掌趣科技	13,913,524.77	3.01
24	603659	璞泰来	13,844,236.74	2.99
25	601231	环旭电子	13,773,874.25	2.98
26	000898	鞍钢股份	13,609,562.94	2.94
27	601801	皖新传媒	13,538,409.73	2.93
28	603501	韦尔股份	13,529,858.82	2.93
29	002100	天康生物	13,487,887.44	2.92
30	600438	通威股份	13,484,314.41	2.92
31	002648	卫星石化	13,372,213.80	2.89
32	002531	天顺风能	13,215,358.71	2.86
33	300357	我武生物	13,140,723.57	2.84
34	300251	光线传媒	13,080,053.54	2.83
35	600201	生物股份	13,061,781.81	2.82
36	603338	浙江鼎力	12,951,637.40	2.80
37	000513	丽珠集团	12,921,185.71	2.79
38	002368	太极股份	12,824,637.55	2.77
39	002557	洽洽食品	12,764,913.76	2.76
40	600764	中国海防	12,739,330.82	2.76
41	300455	康拓红外	12,480,566.06	2.70
42	002597	金禾实业	12,443,595.55	2.69
43	300476	胜宏科技	12,435,776.66	2.69
44	002459	晶澳科技	12,352,861.71	2.67
45	002266	浙富控股	12,328,315.35	2.67
46	600782	新钢股份	12,321,461.61	2.66

47	002643	万润股份	12,234,581.91	2.65
48	000503	国新健康	12,155,939.47	2.63
49	601677	明泰铝业	11,666,999.12	2.52
50	600058	五矿发展	11,628,011.39	2.51
51	300188	美亚柏科	11,581,879.72	2.50
52	002008	大族激光	11,443,266.74	2.47
53	300308	中际旭创	11,133,052.03	2.41
54	600570	恒生电子	11,121,386.04	2.41
55	600755	厦门国贸	11,120,889.56	2.41
56	600276	恒瑞医药	11,011,467.06	2.38
57	300347	泰格医药	10,875,836.65	2.35
58	000858	五粮液	10,859,989.70	2.35
59	002773	康弘药业	10,781,300.38	2.33
60	600519	贵州茅台	10,739,674.93	2.32
61	603866	桃李面包	10,675,213.50	2.31
62	300573	兴齐眼药	10,663,955.41	2.31
63	300552	万集科技	10,663,110.60	2.31
64	688981	中芯国际	10,606,840.86	2.29
65	002025	航天电器	10,574,311.57	2.29
66	002138	顺络电子	10,564,796.01	2.28
67	300782	卓胜微	10,553,624.54	2.28
68	601233	桐昆股份	10,525,779.81	2.28
69	002127	南极电商	10,478,393.77	2.27
70	000539	粤电力 A	10,345,677.96	2.24
71	600036	招商银行	10,308,654.77	2.23
72	300725	药石科技	10,128,137.38	2.19
73	300474	景嘉微	10,099,844.75	2.18
74	002244	滨江集团	9,847,555.07	2.13
75	000728	国元证券	9,832,913.02	2.13
76	601636	旗滨集团	9,802,381.59	2.12
77	002410	广联达	9,727,095.56	2.10
78	000829	天音控股	9,545,898.09	2.06
79	000543	皖能电力	9,394,953.71	2.03
80	300316	晶盛机电	9,390,990.18	2.03
81	600267	海正药业	9,290,650.41	2.01
82	002078	太阳纸业	9,256,349.31	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	4,104,175,881.42
卖出股票收入（成交）总额	4,134,667,204.51

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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
IC2101	IC2101	5	6,343,800.00	159,280.00	-
IC2103	IC2103	10	12,502,800.00	481,200.00	-
公允价值变动总额合计（元）					640,480.00
股指期货投资本期收益（元）					10,828,784.47
股指期货投资本期公允价值变动（元）					640,480.00

#### 8.10.2 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

投资组合的整体风险的目的。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,902,172.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,150.95
5	应收申购款	822.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,915,145.71

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	150	3,172,745.60	474,299,892.29	99.66%	1,611,948.11	0.34%
银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	215	4,088.66	0.00	0.00%	879,061.09	100.00%
合计	365	1,306,276.44	474,299,892.29	99.48%	2,491,009.20	0.52%

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。

### 9.2 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	71,769.69	8.16%
	合计	72,723.88	0.02%

## 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

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

## 9.4 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。

## § 10 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	13,175,905.27	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	2,605,691.45	1,929,838.06
减:本报告期基金总赎回份额	2,117,587.24	2,874,743.85
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	475,911,840.40	879,061.09

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

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 45,000.00 元。该审计机构已为本基金连续提供了 3 年的服务。

### 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	
东方财富证券股份有限公司	4	4,787,282,417.19	58.36%	1,148,353.11	28.24%	新增 2 个交易单元
兴业证券股份有限公司	1	626,313,457.53	7.64%	583,286.37	14.35%	-

中泰证券股份有限公司	4	551,681,773.14	6.73%	513,782.19	12.64%	新增 1 个交易日单元
招商证券股份有限公司	1	378,639,807.96	4.62%	352,628.65	8.67%	-
野村东方国际证券有限公司	2	375,687,979.99	4.58%	274,742.50	6.76%	新增 2 个交易日单元
光大证券股份有限公司	1	364,964,683.71	4.45%	339,892.21	8.36%	-
国盛证券股份有限公司	2	340,041,704.63	4.15%	248,673.88	6.12%	-
东吴证券股份有限公司	2	295,109,423.92	3.60%	215,814.01	5.31%	-
中航证券有限公司	2	253,892,766.62	3.10%	185,671.48	4.57%	-
瑞银证券有限责任公司	1	176,070,197.10	2.15%	163,973.86	4.03%	-
浙商证券股份有限公司	1	53,172,711.33	0.65%	38,885.33	0.96%	-
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	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	4	-	-	-	-	新增 2 个交易日单元
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	3	-	-	-	-	新增 1 个

份有限公司						交易单元
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 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	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。

### 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
东方财富证	2,800,000.00	73.53%	-	-	-	-

券股份有限 公司						
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	26.47%	-	-	-	-
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 融股份有限 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	-	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 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	-	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股 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	三大证券报、中国证	2020年3月13日



	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》	监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	
5	《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
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	四大证券报	2020 年 4 月 22 日

	季度报告提示性公告》		
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
17	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的泰和新材估值方法调整的公告》	中国证券报、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 7 月 14 日
18	《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
19	《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 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
20	《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 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 7 月 29 日
21	《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 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 7 月 29 日
22	《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
23	《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
24	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式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
25	《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
26	《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 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
27	《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

## § 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	2020/01/01-2020/12/31	115,953,826.64	0.00	0.00	115,953,826.64	24.32%
	2	2020/01/01-2020/12/31	231,908,826.64	0.00	0.00	231,908,826.64	48.64%
	3	2020/01/01-2020/12/31	116,435,838.87	0.00	0.00	116,435,838.87	24.42%

#### 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。

### 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 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 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
- 13.1.2 《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》
- 13.1.3 《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》
- 13.1.4 《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》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2021 年 3 月 29 日