

银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券
投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	21
6.3 净资产（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	银华盛世精选灵活配置混合发起式	
基金主代码	003940	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日	
基金管理人	银华基金管理股份有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	2,034,218,043.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C
下属分级基金的交 易代码	003940	014047
报告期末下属分级 基金的份额总额	2,031,366,116.83 份	2,851,926.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选符合中国经济发展方向上具备利润创造能力，并且估值水平具备竞争力的优势上市公司，追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据、政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。本基金为灵活配置混合型基金，长期来看将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，进行短期的战术避险选择。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金。

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	宁波银行股份有限公司
信息披露 姓名	杨文辉	朱广科

负责人	联系电话	(010) 58163000	0574-87050338
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	0574-83895886
传真		(010) 58163027	0574-89103213
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		100738	315100
法定代表人		王珠林	陆华裕

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C
本期已实现收益	-259,592,889.51	-5.24
本期利润	-565,590,448.26	1,607,653.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2609	0.1634
本期加权平均净值利润率	-13.39%	8.00%
本期基金份额净值增长率	-13.53%	-13.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	1,515,873,732.98	2,094,820.79
期末可供分配利		

润		
期末可供分配基金份额利润	0.7462	0.7345
期末基金资产净值	3,553,966,381.25	4,957,662.76
期末基金份额净值	1.7495	1.7384
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	147.58%	-30.27%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银华盛世精选灵活配置混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.69%	1.15%	0.58%	0.42%	0.11%	0.73%
过去三个月	-12.64%	0.99%	-1.73%	0.40%	-10.91%	0.59%
过去六个月	-13.53%	1.00%	1.46%	0.40%	-14.99%	0.60%
过去一年	-24.17%	1.14%	-4.27%	0.47%	-19.90%	0.67%
过去三年	5.14%	1.57%	4.36%	0.58%	0.78%	0.99%
自基金合同生效起至今	147.58%	1.46%	23.09%	0.58%	124.49%	0.88%

银华盛世精选灵活配置混合发起式 C

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	0.66%	1.15%	0.58%	0.42%	0.08%	0.73%
过去三个月	-12.73%	0.99%	-1.73%	0.40%	-11.00%	0.59%
过去六个月	-13.71%	1.00%	1.46%	0.40%	-15.17%	0.60%
过去一年	-24.49%	1.14%	-4.27%	0.47%	-20.22%	0.67%
自基金合同生效起至今	-30.27%	1.35%	-6.86%	0.55%	-23.41%	0.80%

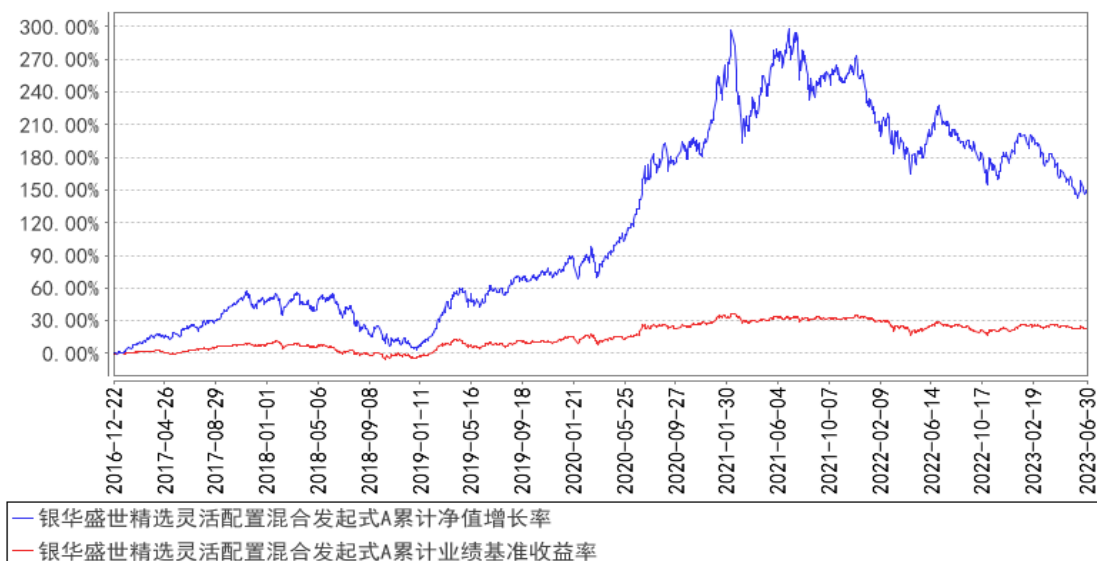
注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%。

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，中证 800 指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。具有一定的权威性和市场代表性。因此，中证 800 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。

中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

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

银华盛世精选灵活配置混合发起式A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



银华盛世精选灵活配置混合发起式C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：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§ 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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 188 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、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投资基金(LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央

企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华深证 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、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、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基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型基金中基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型基金中基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型基金中基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型基金中基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型

证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金（LOF）、银华华智三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基

金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓星先生	本基金的基金经理	2016年12月22日	-	11.5年	硕士学位。曾就职于 ABB（中国）有限公司。2011年3月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员、投资管理部基金经理助理、投资管理一部基金经理，现任公司业务副总经理、投资管理一部投资总监、基金经理、投资经理（社保基本养老保险）、主动型股票投资决策专门委员会联席主席。自2015年7月7日起担任银华中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，自2016年12月22日起兼任银华盛世精选灵活配置混合发起式证券投资基金基金经理，自2017年8月11日至2020年11月20日兼任银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2017年11月3日至2020年9月2日兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月12日起兼任银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年7月5日起兼任银华心怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年8月15日至2019年9月20日兼任银华战略新兴灵活配置定期开放混合发起式证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年12月16日起兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2020年4月1日至2021年8月18日兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年4月30日起兼任银华丰享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2021年1月8日起兼任银华心佳两年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2021年3月4日起兼任银华心享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2022年1月20日起兼任银华心兴三年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2022年2月23日起兼任银

					华心选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
张萍女士	本基金的基金经理	2018年11月6日	-	12.5年	硕士学位。曾就职于中信建投证券股份有限公司，于2015年8月加入银华基金，历任行业研究员、投资经理职务，现任投资管理一部基金经理。自2018年11月6日起担任银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合发起式证券投资基金基金经理，自2018年11月6日至2020年9月2日兼任银华估值优势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基金经理，自2019年3月19日起兼任银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年9月20日起兼任银华心怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2019年12月16日至2022年9月6日兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2020年4月1日至2022年11月1日兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2020年11月11日起兼任银华品质消费股票型证券投资基金基金经理，自2021年3月4日起兼任银华心享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2022年1月20日起兼任银华心兴三年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2022年2月23日起兼任银华心选一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自2023年3月30日起兼任银华心质混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
孙昊天先生	本基金的基金经理助理	2022年12月18日	-	4.5年	硕士学位。2018年7月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员、行业研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
梅思寒先生	本基金的基金经理助理	2022年12月23日	-	5.5年	硕士学位。2017年6月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员、行业研究员，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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资

基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合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5次,原因是量化投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,市场整体震荡,行业间分化较大,其中TMT涨幅居前,消费、医药、新能源等均不同程度调整。我们保持高仓位,配置以消费为主,兼顾科技,重点配置了食品饮料、家电、医药、新能源、电子、国防军工等行业,精选高景气行业中高增长的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华盛世精选灵活配置混合发起式A基金份额净值为1.7495元,本报告期基金份额净值增长率为-13.53%;截至本报告期末银华盛世精选灵活配置混合发起式C基金份额净值为1.7384元,本报告期基金份额净值增长率为-13.71%;业绩比较基准收益率为1.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年,我们整体基金收益率并没有达到预期,也出现了很少有的跑输了基准的现象。从市场因子的表现来说,小市值和低pb等因子表现较为出众,大市值和质量因子表现不佳,业绩

增速因子没有发挥出过去的优势。我们的投资方法是投资于基本面景气周期向上行业中的业绩维持较快增长的优质公司，映射到因子上，大部分的投资标的落在中大市值中的优质白马成长股，小市值和低 pb 的标的并不多。投资方法和市场风格的偏好出现了阶段性的错配，导致了我们的基金收益率阶段性的跑输了基准。当标的出现顺行业基本面逆市场风格的时候，往往代表着不错的加仓时点，从操作上来说，我们选择了坚守自己的投资方法，减持了持仓中估值已经泡沫化的标的，增持了估值处于相对低位的标的。我们相信，从中长期的维度来看，具有业绩持续成长能力优质公司会持续贡献超额。同时由于可选择的标的变得更多，我们的持仓也变得更为分散一些。

我们持续看好高质量发展的方向，看好下半年的经济信心回升，结合我们的整体宏观判断，目前我们的组合集中在低碳经济、国家安全、数字经济、医疗健康和美好生活几个方向，泛新能源是我们总体配置最多的板块。高质量发展的映射在于低碳经济和国家安全，这两个板块上半年调整幅度不小，交易拥挤程度基本得到了解决，后面更多会反应相关的业绩增速。经济信心回升的映射主要在于数字经济、医疗健康和美好生活，毕竟现在消费降级成为了不少人谈论的重点，但我们相信随着经济信心的回升，美好生活的追求依然会是消费的长期趋势，这些提到的领域是边际变化最大的方向，无论是业绩趋势还是信心趋势。

电动车方面，行业的去库存和价格战已经进入尾声，中游盈利的下行在上半年逐步体现，下半年来看，国内的需求还在逐步修复，欧洲的需求已经有加速的迹象，美国的高增长也在预期内，整个板块股价调整的时间足够长幅度足够大，悲观预期基本上都得到了体现。当前的位置我们更加积极地看多。整车、电池和中游材料的盈利虽然都有所下降，但竞争格局也在发生积极的变化，龙头公司的盈利能力还在持续超预期，我们主要聚焦在后续盈利能力见底后保持稳定以及海外占比较高的环节。

光伏方面，硅料产能的扩张带动产业链价格快速下行，潜在需求在快速增长，这个产业大逻辑并没有发生变化。上半年的调整更多是交易结构和股价位置的因素，对于格局的担忧已经充分 price in，很多股票跌到了估值非常便宜的位置。从单位盈利上来说，有些辅材环节的盈利已经见底回升，主产业链里面的高效产能依然是供不应求，这些环节的龙头公司我们还是继续看好。

风电方面，23 年的装机增速值得期待，虽然第二季度的出货节奏略有放缓，但我们继续看好。上游零部件的盈利修复在一季度已经体现，估值也相对合理；海风的装机节奏有所延迟但趋势没有变化，往后看积极因素更多，仍然是空间极大的环节，相关公司的估值和股价也调整到了具有吸引力的位置。

储能方面，行业整体仍然处于爆发期，但竞争在变得更加激烈，此前估值走在盈利前面，但经过上半年大幅度的股价调整之后，估值和增速的性价比开始匹配，逐步进入可以加仓的阶段，

我们也更加积极的看多。

科技方面，AIGC 人工智能技术革命推动下的 TMT 方向是今年以来的最大热点，无论海外还是国内市场相关 AI 标的均有较大涨幅。AI 产业在突破“技术奇点”后，将进入新一轮成长周期，但需要关注的是 AI 发展不会一蹴而就，中间也必然会有曲折，包括数据隐私、道德伦理等潜在风险，可能造成板块后续波动。投资机会上，“卖水人”硬件先行的算力产业链，在业绩兑现上先于 AI 应用。算力是支撑 AI 新基础设施中的重要生产力，海外芯片龙头给出超预期的业绩指引，海外算力投资在上修，我们判断国内算力建设在政策扶持下将会跟进。随着未来国内通用大模型正式发布，国内大模型应用有望迎来百花齐放，但逢“AI”必涨的第一阶段已经过去，未来需要更多关注运营数据和业绩的兑现。

半导体板块我们做了一些调整，兑现了一些累计涨幅较大的国产替代方向，主要包括半导体设备、材料、零部件环节。在股价位置、市场预期较低的景气复苏方向，我们的看法边际转向积极，左侧布局了一些设计标的。全球半导体下行周期接近尾声，经历了过去几个季度的去库存，有望在今年下半年重启上行周期，向上弹性取决于各下游需求恢复的力度。

港股互联网板块股价位置和估值都是底部位置，而基本面从去年下半年就出现持续上行的状态。在反垄断、流量红利消失的大背景下，降本增效仍是未来一个阶段互联网板块业绩持续上行的重要因素。同时，在 AI 产业崛起的当下，我们认为港股的核心互联网公司最有可能抓住 AI 浪潮下的机遇，使得自身的体量上个台阶，结合当下的估值水平，有望迎来业绩估值双升的行情。

国防军工行业基本面和股价处于周期性底部，基本面看好军工行业需求重启。估值方面，回溯五年，大部分行业龙头的 PE 处于历史估值分位数 5% 以下。展望未来，由于军工行业进入壁垒较高，格局稳固，军工各细分行业龙头业绩也有望重新向上。我们优选调整较大、国产化率较低的军工芯片，摆脱供给端约束的导弹链以及有望加强建设的军工信息化方向，同时关注无人机等新兴产业。

消费方面，二季度经历了强预期强现实到弱预期弱现实的快速回落，大部分消费成长股都遭遇到较大的估值调整，市场将一些中长期逐步消化的慢变量，如人口结构、经济转型等，较大程度的放大在消费龙头公司上，对未来的不确定性给予了较大的估值折价。对于食品饮料、家电等相对格局较好的领域，我们认为龙头公司的壁垒依然能够维持多年的稳健增长，目前估值性价比很好。对于新兴的消费行业，当下确实还在挤泡沫的阶段，行业从野蛮生长走向理性，优质公司也会脱颖而出。

短期由于经济复苏和消费信心的回暖仍较为缓慢，但很多公司估值已经回到了非常便宜的位置，只是基本面的复苏需要时间，目前仍然在弱复苏的轨道上，结构上仍然存在压力，行业内挤

压式竞争表现的更加明显，我们预计这个阶段就是龙头再次抓住机会进一步提升市占率的阶段。我们持仓上进一步向竞争壁垒高、管理能力强的公司集中，相信业绩是穿越周期最强有力的武器。后续随着政策的发力，预期的回升，我们会逐步增加弹性标的。

医药方面，二季度申万医药指数下跌 7.29%，只有如中药、流通等低估值板块表现较好，CXO、消费医疗、药品、器械都没有板块性行情。在当前位置，我们对医药并不悲观，过去十几年的经验告诉我们，医药是个长牛行业。在任何经济周期里都有好公司。尤其是当前人口老龄化、产业升级的背景下，医药行业中具备核心竞争力、符合产业趋势的优秀企业值得长期投资。

价值方面，随着房地产政策的边际变化，我们判断下半年整体经济形势也将环比好转。房地产极大程度影响银行的资产质量，在房地产核心数据好转之前，政策的支持力度不会减弱。我们看好银行资产质量的好转，以及估值的修复。相比对公银行，零售银行的基本面改善较为缓慢，但估值分位在历史低位，适合以时间换空间。保险公司的负债端增速较快，但资产端较低的利率水平也将拉低其预期投资收益率水平。对于地产股，我们认为在增量有限的背景下，还是要选择有份额提升潜力的央企为主，并辅以销售阶段性较强的地方性国企。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	416,145,165.77	353,354,435.62
结算备付金		4,095,730.38	9,719,920.04
存出保证金		1,754,513.03	2,464,565.82
交易性金融资产	6.4.7.2	3,115,841,601.90	4,470,396,790.75
其中：股票投资		3,115,841,601.90	4,470,396,790.75
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		31,166,594.97	37,305,971.43
应收股利		-	-
应收申购款		1,393,009.10	2,822,030.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,570,396,615.15	4,876,063,713.76
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	670,875.92
应付赎回款		3,012,308.84	2,577,649.42
应付管理人报酬		4,444,003.21	6,066,994.82
应付托管费		740,667.24	1,011,165.77
应付销售服务费		1,607.83	2,602.07
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,273,984.02	5,999,709.78
负债合计		11,472,571.14	16,328,997.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,034,218,043.79	2,402,048,985.90
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,524,706,000.22	2,457,685,730.08
净资产合计		3,558,924,044.01	4,859,734,715.98
负债和净资产总计		3,570,396,615.15	4,876,063,713.76

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,034,218,043.79 份，其中银华盛世精选灵活配置混合发起式 A 基金份额总额 2,031,366,116.83 份，基金份额净值 1.7495 元；银华盛世精选灵活配置混合发起式 C 基金份额总额 2,851,926.96 份，基金份额净值 1.7384 元。

6.2 利润表

会计主体：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-526,785,206.90	-474,377,560.88
1. 利息收入		2,136,913.19	2,308,348.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,136,913.19	2,308,348.77
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
证券出借利息收 入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-225,537,734.35	-532,098,434.82
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-252,418,168.12	-561,826,444.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	911,624.38	1,118,650.84
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	25,968,809.39	28,609,358.64
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-304,389,900.23	53,699,679.78
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	1,005,514.49	1,712,845.39
减：二、营业总支出		37,197,588.08	45,078,900.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	31,752,328.51	38,465,809.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,292,054.74	6,410,968.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	44,105.91	93,016.04
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2.98	11.72
8. 其他费用	6.4.7.23	109,095.94	109,095.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-563,982,794.98	-519,456,461.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-563,982,794.98	-519,456,461.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-563,982,794.98	-519,456,461.86

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,402,048,985.90	-	2,457,685,730.08	4,859,734,715.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,402,048,985.90	-	2,457,685,730.08	4,859,734,715.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-367,830,942.11	-	-932,979,729.86	-1,300,810,671.97
（一）、综合收益总额	-	-	-563,982,794.98	-563,982,794.98
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-367,830,942.11	-	-368,996,934.88	-736,827,876.99

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	168,162,444.33	-	164,099,278.66	332,261,722.99
2. 基金赎回款	-535,993,386.44	-	-533,096,213.54	-1,069,089,599.98
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,034,218,043.79	-	1,524,706,000.22	3,558,924,044.01
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,636,422,904.59	-	3,960,803,588.32	6,597,226,492.91
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,636,422,904.59	-	3,960,803,588.32	6,597,226,492.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-208,391,680.99	-	-786,935,980.85	-995,327,661.84
(一)、综合收益总额	-	-	-519,456,461.86	-519,456,461.86
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-208,391,680.99	-	-267,479,518.99	-475,871,199.98

其中：1. 基金申购款	450,034,913.88	-	511,652,143.92	961,687,057.80
2. 基金赎回款	-658,426,594.87	-	-779,131,662.91	-1,437,558,257.78
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,428,031,223.60	-	3,173,867,607.47	5,601,898,831.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华盛世精选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【2016】2738 号文《关于准予银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册并公开发行,由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起,于 2016 年 12 月 12 日至 2016 年 12 月 16 日向社会公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限为不定期,募集期间净认购资金总额为人民币 21,802,102.62 元,在募集期间产生的利息为人民币 2,007.61 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 21,804,110.23 元,折合 21,804,110.23 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所验证。经向中国证监会备案后,基金合同于 2016 年 12 月 22 日生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《银华基金管理股份有限公司关于旗下银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，为更好地满足广大投资人的理财需求，本基金管理人经与基金托管人宁波银行股份有限公司协商一致，决定自 2021 年 11 月 18 日起对本基金增设 C 类基金份额，据此对本基金的基金合同、托管协议做相应修改。本基金的原有基金份额全部转为 A 类基金份额。

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 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包含国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金、权证、股指期货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的相关规定)；本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准是：中证 800 指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的

经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、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,暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	416,145,165.77
等于：本金	416,034,149.87
加：应计利息	111,015.90
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	416,145,165.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,489,157,055.55	-	3,115,841,601.90	-373,315,453.65
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	3,489,157,055.55	-	3,115,841,601.90	-373,315,453.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,393.36
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,160,494.72
其中：交易所市场	3,160,494.72
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	3,273,984.02

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华盛世精选灵活配置混合发起式 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,398,912,454.68	2,398,912,454.68
本期申购	121,765,492.76	121,765,492.76
本期赎回（以“-”号填列）	-489,311,830.61	-489,311,830.61
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,031,366,116.83	2,031,366,116.83

银华盛世精选灵活配置混合发起式 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,136,531.22	3,136,531.22
本期申购	46,396,951.57	46,396,951.57
本期赎回（以“-”号填列）	-46,681,555.83	-46,681,555.83
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,851,926.96	2,851,926.96

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

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

银华盛世精选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	2,092,803,472.45	361,699,965.82	2,454,503,438.27
本期利润	-259,592,889.51	-305,997,558.75	-565,590,448.26
本期基金份额交易产生的变动数	-317,336,849.96	-48,975,875.63	-366,312,725.59
其中：基金申购款	104,390,095.70	13,368,448.39	117,758,544.09
基金赎回款	-421,726,945.66	-62,344,324.02	-484,071,269.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,515,873,732.98	6,726,531.44	1,522,600,264.42

银华盛世精选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	2,710,315.44	471,976.37	3,182,291.81
本期利润	-5.24	1,607,658.52	1,607,653.28
本期基金份额交易产生的变动数	-615,489.41	-2,068,719.88	-2,684,209.29
其中：基金申购款	40,026,992.73	6,313,741.84	46,340,734.57
基金赎回款	-40,642,482.14	-8,382,461.72	-49,024,943.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,094,820.79	10,915.01	2,105,735.80

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,057,708.35
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	61,377.06
其他	17,827.78
合计	2,136,913.19

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-252,418,168.12
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-252,418,168.12

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	5,841,148,596.73
减：卖出股票成本总额	6,077,820,863.12
减：交易费用	15,745,901.73
买卖股票差价收入	-252,418,168.12

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	825.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	910,798.94
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	911,624.38

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,760,879.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,849,000.00
减：应计利息总额	850.24
减：交易费用	230.69
买卖债券差价收入	910,798.94

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	25,968,809.39
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	25,968,809.39

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-304,389,900.23
股票投资	-304,389,900.23
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-304,389,900.23

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	986,531.79
基金转换费收入	18,982.70
合计	1,005,514.49

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	109,095.94

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	31,752,328.51	38,465,809.04

其中：支付销售机构的客户维护费	11,635,877.27	13,112,431.22
-----------------	---------------	---------------

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,292,054.74	6,410,968.24

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	36,356.61	36,356.61
合计	-	36,356.61	36,356.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	银华盛世精选灵活配置 混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置 混合发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	82,009.56	82,009.56
合计	-	82,009.56	82,009.56

注：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 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	银华盛世精选灵活配置混合发起 式 A	银华盛世精选灵活配置混合 发起式 C
基金合同生效日(2016 年 12 月 22 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,200.12	-
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	10,001,200.12	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.49%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日(2016年12月22日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,200.12	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,200.12	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.42%	-

注: 1、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。

2、对于分级基金, 下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注: 无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行	416,145,165.77	2,057,708.35	558,012,146.96	2,223,917.35

注: 本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管, 按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监

负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	416,145,165.77	-	-	-	416,145,165.77
结算备付金	4,095,730.38	-	-	-	4,095,730.38
存出保证金	1,754,513.03	-	-	-	1,754,513.03
交易性金融资产	-	-	-	3,115,841,601.90	3,115,841,601.90
应收申购款	-	-	-	1,393,009.10	1,393,009.10
应收清算款	-	-	-	31,166,594.97	31,166,594.97
资产总计	421,995,409.18	-	-	3,148,401,205.97	3,570,396,615.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,012,308.84	3,012,308.84
应付管理人报酬	-	-	-	4,444,003.21	4,444,003.21
应付托管费	-	-	-	740,667.24	740,667.24
应付销售服务费	-	-	-	1,607.83	1,607.83
其他负债	-	-	-	3,273,984.02	3,273,984.02
负债总计	-	-	-	11,472,571.14	11,472,571.14
利率敏感度缺口	421,995,409.18	-	-	3,136,928,634.83	3,558,924,044.01
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	353,354,435.62	-	-	-	353,354,435.62
结算备付金	9,719,920.04	-	-	-	9,719,920.04
存出保证金	2,464,565.82	-	-	-	2,464,565.82
交易性金融资产	-	-	-	4,470,396,790.75	4,470,396,790.75
应收申购款	-	-	-	2,822,030.10	2,822,030.10
应收清算款	-	-	-	37,305,971.43	37,305,971.43
资产总计	365,538,921.48	-	-	4,510,524,792.28	4,876,063,713.76
负债					

应付赎回款	-	-	-	2,577,649.42	2,577,649.42
应付管理人报酬	-	-	-	6,066,994.82	6,066,994.82
应付托管费	-	-	-	1,011,165.77	1,011,165.77
应付清算款	-	-	-	670,875.92	670,875.92
应付销售服务费	-	-	-	2,602.07	2,602.07
其他负债	-	-	-	5,999,709.78	5,999,709.78
负债总计	-	-	-	16,328,997.78	16,328,997.78
利率敏感度缺口	365,538,921.48	-	-	-4,494,195,794.50	4,859,734,715.98

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：基金本期末（上期末）持有的资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险包含单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，以及市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	3,115,841,601.90	87.55	4,470,396,790.75	91.99
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	3,115,841,601.90	87.55	4,470,396,790.75	91.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	318,634,126.24	488,101,705.76
业绩比较基准下降 5%	-318,634,126.24	-488,101,705.76	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,115,833,662.40	4,443,664,841.31
第二层次	-	-
第三层次	7,939.50	26,731,949.44
合计	3,115,841,601.90	4,470,396,790.75

6.4.14.2.2 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将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,115,841,601.90	87.27
	其中：股票	3,115,841,601.90	87.27
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	420,240,896.15	11.77

8	其他各项资产	34,314,117.10	0.96
9	合计	3,570,396,615.15	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,286,317.00	0.32
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,901,415,044.23	81.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	78,854,402.52	2.22
G	交通运输、仓储和邮政业	6,501,756.00	0.18
H	住宿和餐饮业	23,471,594.50	0.66
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,649,726.67	1.09
J	金融业	16,409,855.00	0.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,176.48	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,883,980.00	0.59
Q	卫生和社会工作	18,358,749.50	0.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,115,841,601.90	87.55

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	1,853,980	303,255,508.60	8.52
2	600519	贵州茅台	173,544	293,462,904.00	8.25
3	000568	泸州老窖	1,394,513	292,248,089.41	8.21
4	300896	爱美客	292,013	129,931,184.35	3.65
5	603345	安井食品	857,467	125,876,155.60	3.54
6	600600	青岛啤酒	1,145,677	118,726,507.51	3.34

7	300122	智飞生物	2,325,670	102,794,614.00	2.89
8	000596	古井贡酒	336,075	83,138,233.50	2.34
9	603198	迎驾贡酒	1,263,300	80,598,540.00	2.26
10	600809	山西汾酒	380,464	70,412,472.48	1.98
11	605117	德业股份	458,075	68,505,116.25	1.92
12	603369	今世缘	1,292,756	68,257,516.80	1.92
13	002311	海大集团	1,396,300	65,402,692.00	1.84
14	603456	九洲药业	2,230,806	61,079,468.28	1.72
15	002049	紫光国微	550,160	51,302,420.00	1.44
16	000963	华东医药	1,155,596	50,118,198.52	1.41
17	603605	珀莱雅	434,912	48,884,108.80	1.37
18	000860	顺鑫农业	1,385,599	46,680,830.31	1.31
19	688439	振华风光	414,881	45,562,231.42	1.28
20	300430	诚益通	2,725,767	45,002,413.17	1.26
21	000651	格力电器	1,161,948	42,422,721.48	1.19
22	002025	航天电器	646,986	41,277,706.80	1.16
23	603801	志邦家居	1,167,800	38,560,756.00	1.08
24	002475	立讯精密	1,173,000	38,063,850.00	1.07
25	688981	中芯国际	680,364	34,371,989.28	0.97
26	600690	海尔智家	1,357,728	31,879,453.44	0.90
27	603899	晨光股份	679,000	30,310,560.00	0.85
28	003000	劲仔食品	2,231,000	28,088,290.00	0.79
29	600779	水井坊	464,000	27,371,360.00	0.77
30	300957	贝泰妮	306,435	27,235,942.80	0.77
31	600887	伊利股份	940,700	26,640,624.00	0.75
32	603444	吉比特	45,500	22,345,505.00	0.63
33	301263	泰恩康	1,031,400	21,535,632.00	0.61
34	002607	中公教育	4,443,400	20,883,980.00	0.59
35	300595	欧普康视	688,675	20,791,098.25	0.58
36	603712	七一二	669,500	20,225,595.00	0.57
37	688008	澜起科技	331,080	19,010,613.60	0.53
38	301267	华夏眼科	301,210	18,358,749.50	0.52
39	603501	韦尔股份	179,756	17,623,278.24	0.50
40	603218	日月股份	884,571	16,798,003.29	0.47
41	002567	唐人神	2,450,800	16,297,820.00	0.46
42	300593	新雷能	706,570	16,187,518.70	0.45
43	688116	天奈科技	318,528	14,572,656.00	0.41
44	301073	君亭酒店	394,350	14,334,622.50	0.40
45	688249	晶合集成	748,304	14,120,496.48	0.40
46	601318	中国平安	289,400	13,428,160.00	0.38
47	603517	绝味食品	352,200	13,084,230.00	0.37
48	603267	鸿远电子	196,500	12,831,450.00	0.36
49	002196	方正电机	1,702,100	11,982,784.00	0.34

50	300973	立高食品	169,251	11,580,153.42	0.33
51	688016	心脉医疗	61,556	11,072,693.28	0.31
52	603606	东方电缆	225,000	11,031,750.00	0.31
53	688169	石头科技	34,069	10,925,246.92	0.31
54	603477	巨星农牧	326,500	10,888,775.00	0.31
55	000921	海信家电	403,900	10,885,105.00	0.31
56	000848	承德露露	1,228,800	10,874,880.00	0.31
57	688617	惠泰医疗	28,918	10,808,102.50	0.30
58	000333	美的集团	179,300	10,564,356.00	0.30
59	001311	多利科技	181,598	10,429,173.14	0.29
60	600872	中炬高新	282,504	10,393,322.16	0.29
61	002867	周大生	533,800	9,490,964.00	0.27
62	600754	锦江酒店	215,800	9,136,972.00	0.26
63	002756	永兴材料	145,400	9,103,494.00	0.26
64	002271	东方雨虹	321,300	8,758,638.00	0.25
65	002372	伟星新材	407,600	8,372,104.00	0.24
66	002605	姚记科技	166,600	7,735,238.00	0.22
67	300502	新易盛	111,740	7,594,967.80	0.21
68	688793	XR 倍轻松	138,211	7,449,572.90	0.21
69	300115	长盈精密	618,400	7,365,144.00	0.21
70	600522	中天科技	454,900	7,237,459.00	0.20
71	000034	神州数码	270,800	7,200,572.00	0.20
72	002991	甘源食品	93,100	7,140,770.00	0.20
73	002396	星网锐捷	306,800	6,930,612.00	0.19
74	603707	健友股份	511,400	6,903,900.00	0.19
75	002120	韵达股份	680,100	6,501,756.00	0.18
76	002387	维信诺	654,900	6,005,433.00	0.17
77	000786	北新建材	239,900	5,879,949.00	0.17
78	688227	品高股份	213,949	5,312,353.67	0.15
79	002847	盐津铺子	52,900	4,499,145.00	0.13
80	688772	珠海冠宇	212,838	4,288,685.70	0.12
81	300806	斯迪克	219,240	4,104,172.80	0.12
82	300124	汇川技术	63,300	4,064,493.00	0.11
83	688210	统联精密	190,355	3,715,729.60	0.10
84	603816	顾家家居	97,000	3,700,550.00	0.10
85	300496	中科创达	33,800	3,256,630.00	0.09
86	300490	华自科技	179,400	3,078,504.00	0.09
87	601825	沪农商行	547,100	2,981,695.00	0.08
88	688326	经纬恒润	17,953	2,592,233.67	0.07
89	000938	紫光股份	32,600	1,038,310.00	0.03
90	601579	会稽山	71,800	846,522.00	0.02
91	002850	科达利	6,200	819,950.00	0.02
92	002557	洽洽食品	12,500	519,375.00	0.01

93	300308	中际旭创	3,200	471,840.00	0.01
94	600975	新五丰	41,200	393,872.00	0.01
95	000888	峨眉山 A	888	10,176.48	0.00
96	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
97	300498	温氏股份	200	3,670.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	422,170,897.46	8.69
2	603369	今世缘	225,023,940.31	4.63
3	000596	古井贡酒	196,422,760.70	4.04
4	603198	迎驾贡酒	188,420,715.01	3.88
5	000860	顺鑫农业	173,154,189.34	3.56
6	600519	贵州茅台	153,686,064.06	3.16
7	002304	洋河股份	145,337,360.11	2.99
8	600702	舍得酒业	136,898,188.01	2.82
9	000651	格力电器	123,547,004.72	2.54
10	600600	青岛啤酒	115,620,323.70	2.38
11	000333	美的集团	94,560,779.38	1.95
12	600059	古越龙山	92,803,757.00	1.91
13	688390	固德威	87,607,189.27	1.80
14	300973	立高食品	80,005,567.51	1.65
15	000799	酒鬼酒	77,578,536.56	1.60
16	600779	水井坊	70,871,628.61	1.46
17	603605	珀莱雅	70,646,190.54	1.45
18	603517	绝味食品	69,850,904.00	1.44
19	603218	日月股份	57,170,982.68	1.18
20	002311	海大集团	54,535,336.48	1.12

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000596	古井贡酒	251,109,522.16	5.17
2	600809	山西汾酒	217,528,503.18	4.48
3	600519	贵州茅台	208,037,437.86	4.28
4	603369	今世缘	206,901,086.13	4.26
5	300498	温氏股份	143,141,743.58	2.95
6	002304	洋河股份	142,459,151.92	2.93
7	000860	顺鑫农业	131,093,321.92	2.70

8	002594	比亚迪	128,776,336.31	2.65
9	002459	晶澳科技	117,199,826.30	2.41
10	600702	舍得酒业	115,372,684.30	2.37
11	000963	华东医药	114,270,708.94	2.35
12	603198	迎驾贡酒	110,404,420.56	2.27
13	002311	海大集团	102,138,090.45	2.10
14	300015	爱尔眼科	99,320,514.64	2.04
15	600298	安琪酵母	93,610,964.10	1.93
16	600059	古越龙山	91,338,309.76	1.88
17	601888	中国中免	91,119,076.40	1.87
18	000333	美的集团	89,970,290.88	1.85
19	688390	固德威	86,232,068.64	1.77
20	300896	爱美客	84,031,595.60	1.73

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,027,655,574.50
卖出股票收入（成交）总额	5,841,148,596.73

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,754,513.03
2	应收清算款	31,166,594.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,393,009.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,314,117.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
银华盛世 精选灵活 配置混合 发起式 A	211,292	9,614.02	175,629,208.73	8.65	1,855,736,908.10	91.35
银华盛世 精选灵活 配置混合 发起式 C	867	3,289.42	2,233.39	0.08	2,849,693.57	99.92
合计	212,159	9,588.18	175,631,442.12	8.63	1,858,586,601.67	91.37

注：对于分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算当中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理 人所有从 业人员持 有本基金	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	4,516,896.65	0.22
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	294,406.55	10.32
	合计	4,811,303.20	0.24

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	10~50
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本 开放式基金	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	>100
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	10~50
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额 占基金总 份 额比例	发起份 额 总数	发起份 额 占 基金总份 额 比例 (%)	发起份 额承 诺持有期 限

		(%)			
基金管理人固有资金	10,001,200.12	0.49	10,001,200.12	0.49	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	10,001,200.12	0.49	10,001,200.12	0.49	3年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日 (2016年12月22日)基金份额总额	21,804,110.23	-
本报告期期初基金份额总额	2,398,912,454.68	3,136,531.22
本报告期基金总申购份额	121,765,492.76	46,396,951.57
减：本报告期基金总赎回份额	489,311,830.61	46,681,555.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,031,366,116.83	2,851,926.96

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	4	4,681,785,723.81	43.08	3,949,729.32	43.65	-
安信证券	4	2,058,849,635.46	18.94	1,917,415.06	21.19	-
光大证券	3	2,054,661,571.67	18.9	1,502,615.44	16.6	-
天风证券	2	617,458,921.01	5.68	451,547.50	4.99	-
国信证券	2	550,323,614.61	5.06	512,516.70	5.66	-
广发证券	2	380,364,245.40	3.5	278,159.69	3.07	-
中银国际	2	266,330,267.39	2.45	248,032.27	2.74	-
东吴证券	2	258,859,610.	2.38	189,307.65	2.09	-

		17				
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
东方证券	1					
华创证券	2					

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	5,760,879.87	100.00	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君	-	-	-	-	-	-

安						
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 1 月 20 日
3	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 3 月 31 日
5	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 20 日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 4 月 20 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

12.1.2 《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

12.1.4 《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 29 日