

银华稳健增利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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	20
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	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64

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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 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	21,389,840.19 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	19,661,742.79 份	1,728,097.40 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 C2 办公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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	331,639.66	-159,225.14
本期利润	1,171,615.26	257,308.57
加权平均基金份额本期利润	0.0601	0.1643
本期加权平均净值利润率	3.90%	10.91%
本期基金份额净值增长率	3.74%	3.57%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	10,205,343.31	852,139.17
期末可供分配基金份额利润	0.5190	0.4931
期末基金资产净值	29,867,086.10	2,580,236.57
期末基金份额净值	1.5190	1.4931
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	51.90%	49.31%

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

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.57%	0.81%	0.48%	0.42%	0.09%	0.39%
过去三个月	-3.33%	0.68%	-2.09%	0.39%	-1.24%	0.29%
过去六个月	3.74%	0.67%	0.54%	0.39%	3.20%	0.28%
过去一年	-6.62%	0.89%	-5.61%	0.46%	-1.01%	0.43%
过去三年	30.95%	1.20%	-0.40%	0.57%	31.35%	0.63%
自基金合同生效之日起至今	51.90%	1.19%	5.67%	0.62%	46.23%	0.57%

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

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

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	0.54%	0.81%	0.48%	0.42%	0.06%	0.39%
过去三个月	-3.41%	0.68%	-2.09%	0.39%	-1.32%	0.29%
过去六个月	3.57%	0.67%	0.54%	0.39%	3.03%	0.28%
过去一年	-6.94%	0.89%	-5.61%	0.46%	-1.33%	0.43%
过去三年	29.59%	1.20%	-0.40%	0.57%	29.99%	0.63%
自基金合同生效 起至今	49.31%	1.19%	5.67%	0.62%	43.64%	0.57%

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%。

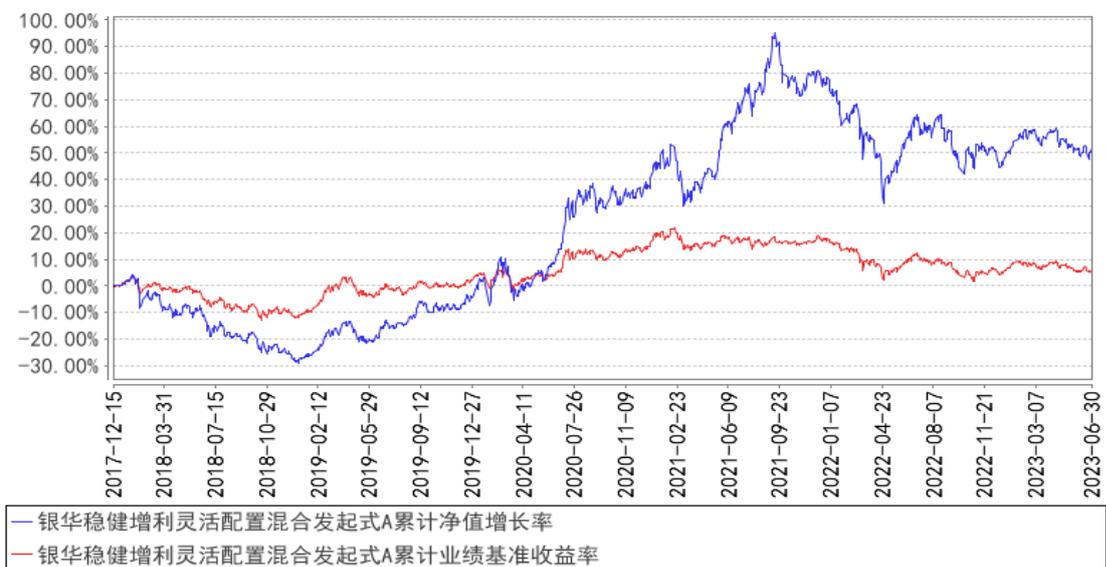
中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 800 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模居前、流动性良好的股票，目前中证 800 指数样本覆盖了沪深市场近八成左右的市值，综合反映沪深证券市场中大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性。

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

银华稳健增利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



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业有限公司 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、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 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、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、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		
马君女士	本基金的基金经理	2017 年 12 月 15 日	-	14.5 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

				<p>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 日至 2021 年 8 月 18 日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 日至 2022 年 8 月 9 日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 日至 2022 年 6 月 29 日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，自 2022 年 4 月 20 日起兼任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基金经理，自 2022 年 6 月 2 日起兼任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基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 15 日起兼任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）基金经理，自 2023 年 3 月 17 日起兼任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基金经理，自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值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	2021 年 11 月 29 日	-	10.5 年	硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。2015 年 7 月加入银华基金, 历任量化投资部量化研究员, 量化投资部基金经理助理, 现任量化投资部基金经理。自 2021 年 11 月 29 日起担任银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF)、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材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、银华中证等权重 90 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 自 2021 年 11 月 29 日至 2023 年 3 月 16 日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。具有从业资格。国籍: 中国。
张凯先生	本基金的基金经理	2021 年 9 月 28 日	-	13.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加入银华基金, 历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理, 现任量化投资部副总监、基金经理。自 2012 年 11 月 14 日至 2020 年 11 月 25 日担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理, 自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理, 自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理, 自 2016 年 4 月 7 日起兼任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基金经理, 自 2016 年 4 月 25 日至 2018 年 11 月 30 日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 11 月 29 日兼任银华沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理, 自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 7 月 23 日兼任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2019 年 8 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华深证 100 指数分级证券投资基金基金经理, 自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 9 月 17 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2020 年 11 月 26 日至 2022

					<p>年 7 月 28 日兼任银华中证等权重 90 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 自 2020 年 11 月 30 日起兼任银华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 自 2021 年 2 月 3 日至 2022 年 2 月 23 日兼任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基金经理, 自 2021 年 5 月 13 日至 2022 年 6 月 17 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2021 年 7 月 29 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2021 年 9 月 22 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2021 年 9 月 28 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、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理, 自 2021 年 11 月 19 日起兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理, 自 2021 年 12 月 20 日至 2023 年 7 月 28 日兼任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基金经理, 自 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 自 2022 年 3 月 7 日起兼任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基金经理, 自 2022 年 11 月 24 日起兼任银华中证 1000 增强策略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>
--	--	--	--	--	---

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

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 1.5190 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.74%;截至本报告期末银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额净值为 1.4931 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.57%;业绩比较基准收益率为 0.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中,经济运行经历了一次从脉冲上行到缓慢回落的过程。首先,年初的春节效应叠加疫情政策优化,使一季度经济呈现脉冲式反弹,客流、消费都迎来了大幅度同比上升;而进入四月后,伴随着上述两大效应进入尾声,外需偏弱、地产投资向下等经济周期性因素逐步显现,经济运行从高位开始逐步回落。海外方面,美联储以加息压制通胀的过程仍在持续,这种弱外需状态在全球各个出口型经济体数据上都有体现。在上述因素的作用下,A 股市场主要指数在上半年呈现冲高回落,明显分化的状态。行业层面,通信、传媒、计算机等行业表现领先,餐饮旅游、

房地产、农林牧渔等行业表现相对落后。

展望下半年我们认为，经济的运行自有其内在规律，上半年的经济整体运行状态，包括脉冲回落与行业分化，都是后疫情时代的正常现象，是经济自身周期的体现。我们仍然认为，从经济场景的恢复，到经济活动的扩展，再到收入水平的提升，都将是一个缓慢但可持续的过程。未来一段时期，国内政策、外需出口、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情形的时间范围为 2023 年 1 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现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

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：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	2,163,721.04	4,667,897.36
结算备付金		240,796.80	264,112.06
存出保证金		12,893.52	1,817.31
交易性金融资产	6.4.7.2	30,086,381.34	49,574,251.33
其中：股票投资		29,884,142.82	49,574,251.33
基金投资		-	-
债券投资		202,238.52	-
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		57,813.57	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,525.56	1,493.22

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		32,563,131.83	54,509,571.28
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		-	-
应付赎回款		2,353.69	30,185.73
应付管理人报酬		15,748.21	22,886.92
应付托管费		3,937.06	5,721.73
应付销售服务费		649.15	3,728.03
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	93,121.05	80,069.65
负债合计		115,809.16	142,592.06
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	21,389,840.19	37,355,856.04
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,057,482.48	17,011,123.18
净资产合计		32,447,322.67	54,366,979.22
负债和净资产总计		32,563,131.83	54,509,571.28

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日,基金份额总额 21,389,840.19 份，其中银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 基金份额总额 19,661,742.79 份，基金份额净值 1.5190 元。银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额总额 1,728,097.40 份，基金份额净值 1.4931 元。

6.2 利润表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：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		1,577,330.11	-3,113,948.01
1.利息收入		6,178.18	5,938.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,178.18	5,938.09
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）		175,609.07	-4,724,951.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-205,774.32	-5,026,568.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,482.41	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	379,900.98	301,616.68
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	1,256,509.31	1,601,448.77
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	139,033.55	3,617.05
减：二、营业总支出		148,406.28	147,471.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	96,654.39	96,590.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,163.65	24,147.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,253.99	3,811.93
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	23,334.25	22,921.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,428,923.83	-3,261,419.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,428,923.83	-3,261,419.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		1,428,923.83	-3,261,419.13
----------	--	--------------	---------------

6.3 净资产（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：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)	37,355,856.04	-	17,011,123.18	54,366,979.22
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)	37,355,856.04	-	17,011,123.18	54,366,979.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,966,015.85	-	-5,953,640.70	-21,919,656.55
(一)、综合收益总额	-	-	1,428,923.83	1,428,923.83
(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)	-15,966,015.85	-	-7,382,564.53	-23,348,580.38
其中：1.基金申购款	2,368,588.08	-	1,235,894.49	3,604,482.57
2.基金赎回款	-18,334,603.93	-	-8,618,459.02	-26,953,062.95
(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)	21,389,840.19	-	11,057,482.48	32,447,322.67

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)	20,127,688.91	-	15,778,025.68	35,905,714.59
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)	20,127,688.91	-	15,778,025.68	35,905,714.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	607,922.35	-	-2,813,091.93	-2,205,169.58
(一)、综合收益总额	-	-	-3,261,419.13	-3,261,419.13
(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)	607,922.35	-	448,327.20	1,056,249.55
其中：1.基金申购款	2,008,101.33	-	1,243,580.73	3,251,682.06
2.基金赎回款	-1,400,178.98	-	-795,253.53	-2,195,432.51
(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)	20,735,611.26	-	12,964,933.75	33,700,545.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]857号《关于准予银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于2017年11月13日至2017年12月8日向社会公开募集，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、存托凭证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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

6.4.6.2 增值税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,163,721.04
等于：本金	2,163,518.07
加：应计利息	202.97
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	2,163,721.04

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	30,057,177.19	-	29,884,142.82	-173,034.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	199,358.00	2,278.52	602.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	199,358.00	2,278.52	602.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	30,256,535.19	2,278.52	30,086,381.34	-172,432.37

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,805.56
其中：交易所市场	25,805.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	67,315.49
合计	93,121.05

6.4.7.10 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 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	22,648,637.44	22,648,637.44
本期申购	1,212,653.93	1,212,653.93
本期赎回（以“-”号填列）	-4,199,548.58	-4,199,548.58
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	19,661,742.79	19,661,742.79

银华稳健增利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	14,707,218.60	14,707,218.60
本期申购	1,155,934.15	1,155,934.15
本期赎回（以“-”号填列）	-14,135,055.35	-14,135,055.35
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	1,728,097.40	1,728,097.40

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	16,384,903.98	-5,870,218.99	10,514,684.99
本期利润	331,639.66	839,975.60	1,171,615.26
本期基金份额交易产生的变动数	-2,094,344.00	613,387.06	-1,480,956.94
其中：基金申购款	923,016.59	-274,813.08	648,203.51
基金赎回款	-3,017,360.59	888,200.14	-2,129,160.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,622,199.64	-4,416,856.33	10,205,343.31

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	10,260,190.08	-3,763,751.89	6,496,438.19
本期利润	-159,225.14	416,533.71	257,308.57
本期基金份额交易产生的变动数	-8,865,378.10	2,963,770.51	-5,901,607.59
其中：基金申购款	840,041.13	-252,350.15	587,690.98
基金赎回款	-9,705,419.23	3,216,120.66	-6,489,298.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,235,586.84	-383,447.67	852,139.17

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	4,557.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,532.93
其他	87.60
合计	6,178.18

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	-205,774.32
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	-205,774.32

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	133,996,583.54
减：卖出股票成本总额	133,991,793.15
减：交易费用	210,564.71
买卖股票差价收入	-205,774.32

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	1,482.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	1,482.41
----	----------

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

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	379,900.98
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	379,900.98

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	1,256,509.31
股票投资	1,255,907.31
债券投资	602.00
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	1,256,509.31

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	138,564.98
基金转换费收入	468.57
合计	139,033.55

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	22,315.49
信息披露费	-

证券出借违约金	-
银行费用	1,018.76
合计	23,334.25

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

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	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管理费	96,654.39	96,590.12
其中：支付销售机构的客户维护费	8,924.12	9,218.89

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	24,163.65	24,147.58

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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	-	453.34	453.34
中国工商银行	-	153.26	153.26
合计	-	606.60	606.60

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		
	银华稳健增利灵活配置 混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置 混合发起式 C	合计
中国工商银行	-	205.49	205.49
银华基金管理股份有限公司	-	423.38	423.38
合计	-	628.87	628.87

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

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	50.87%	-
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	51.49%	-

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
中国工商银行	2,163,721.04	4,557.65	2,865,221.25	4,642.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300346	南大光电	2023年6月26日	重大事项停牌	34.39	2023年7月6日	35.60	1,200	40,792.00	41,268.00	-
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	152	972.54	1,059.44	-

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。

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	2,163,721.04	-	-	-	2,163,721.04
结算备付金	240,796.80	-	-	-	240,796.80
存出保证金	12,893.52	-	-	-	12,893.52
交易性金融资产	202,238.52	-	-	29,884,142.82	30,086,381.34
应收申购款	-	-	-	1,525.56	1,525.56
应收清算款	-	-	-	57,813.57	57,813.57
资产总计	2,619,649.88	-	-	29,943,481.95	32,563,131.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,353.69	2,353.69
应付管理人报酬	-	-	-	15,748.21	15,748.21
应付托管费	-	-	-	3,937.06	3,937.06
应付销售服务费	-	-	-	649.15	649.15
其他负债	-	-	-	93,121.05	93,121.05
负债总计	-	-	-	115,809.16	115,809.16
利率敏感度缺口	2,619,649.88	-	-	29,827,672.79	32,447,322.67
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	4,667,897.36	-	-	-	4,667,897.36
结算备付金	264,112.06	-	-	-	264,112.06
存出保证金	1,817.31	-	-	-	1,817.31
交易性金融资产	-	-	-	49,574,251.33	49,574,251.33

应收申购款	-	-	-	1,493.22	1,493.22
资产总计	4,933,826.73	-	-	49,575,744.55	54,509,571.28
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	30,185.73	30,185.73
应付管理人报酬	-	-	-	22,886.92	22,886.92
应付托管费	-	-	-	5,721.73	5,721.73
应付销售服务费	-	-	-	3,728.03	3,728.03
其他负债	-	-	-	80,069.65	80,069.65
负债总计	-	-	-	142,592.06	142,592.06
利率敏感度缺口	4,933,826.73	-	-	49,433,152.49	54,366,979.22

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	29,884,142.82	92.10	49,574,251.33	91.18

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	202,238.52	0.62	-	-
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	30,086,381.34	92.72	49,574,251.33	91.18

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%	2,479,935.78	3,075,327.03
	业绩比较基准下降 5%	-2,479,935.78	-3,075,327.03

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	29,841,815.38	49,574,251.33
第二层次	244,565.96	-
第三层次	-	-
合计	30,086,381.34	49,574,251.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券，若不存在活跃市场未经调整的报价（包括重大事项、新发未上市等原因所致），本基金不会于此期间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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告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	29,884,142.82	91.77
	其中：股票	29,884,142.82	91.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	202,238.52	0.62
	其中：债券	202,238.52	0.62

	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	2,404,517.84	7.38
8	其他各项资产	72,232.65	0.22
9	合计	32,563,131.83	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	280,621.65	0.86
B	采矿业	1,056,234.37	3.26
C	制造业	18,978,858.32	58.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,462,641.35	4.51
E	建筑业	595,318.32	1.83
F	批发和零售业	1,245,620.80	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	747,965.13	2.31
H	住宿和餐饮业	68,462.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,358,370.76	7.27
J	金融业	1,530,918.30	4.72
K	房地产业	172,854.30	0.53
L	租赁和商务服务业	150,388.30	0.46
M	科学研究和技术服务业	161,348.60	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	357,720.92	1.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	229,708.50	0.71
R	文化、体育和娱乐业	444,225.20	1.37
S	综合	42,886.00	0.13
	合计	29,884,142.82	92.10

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	002422	科伦药业	11,000	326,480.00	1.01
2	300146	汤臣倍健	11,851	284,186.98	0.88
3	688002	睿创微纳	5,891	263,916.80	0.81
4	002128	电投能源	18,500	244,570.00	0.75
5	600642	申能股份	32,100	224,379.00	0.69
6	600582	天地科技	38,100	222,123.00	0.68
7	601555	东吴证券	31,674	219,817.56	0.68
8	600399	抚顺特钢	20,700	211,140.00	0.65
9	601997	贵阳银行	39,000	201,240.00	0.62
10	600637	东方明珠	25,667	200,715.94	0.62
11	603613	国联股份	5,394	199,200.42	0.61
12	000598	兴蓉环境	35,100	190,593.00	0.59
13	600970	中材国际	14,900	189,975.00	0.59
14	600131	国网信通	9,300	187,767.00	0.58
15	002249	大洋电机	32,700	186,390.00	0.57
16	600998	九州通	17,786	184,618.68	0.57
17	600863	内蒙华电	43,200	179,280.00	0.55
18	600535	天士力	12,300	178,473.00	0.55
19	002745	木林森	19,200	176,640.00	0.54
20	300003	乐普医疗	7,600	171,836.00	0.53
21	600879	航天电子	19,500	165,555.00	0.51
22	300832	新产业	2,800	165,200.00	0.51
23	600528	中铁工业	16,700	164,996.00	0.51
24	002065	东华软件	22,400	158,144.00	0.49
25	300866	安克创新	1,767	154,612.50	0.48
26	600511	国药股份	3,800	147,630.00	0.45
27	603444	吉比特	300	147,333.00	0.45
28	600489	中金黄金	14,100	145,653.00	0.45
29	000783	长江证券	25,000	145,000.00	0.45
30	000513	丽珠集团	3,700	143,967.00	0.44
31	002044	美年健康	19,900	141,489.00	0.44
32	002025	航天电器	2,200	140,360.00	0.43
33	601139	深圳燃气	19,200	139,968.00	0.43
34	600271	航天信息	10,200	139,638.00	0.43
35	600008	首创环保	48,200	138,816.00	0.43
36	002124	天邦食品	30,200	137,108.00	0.42
37	601699	潞安环能	8,400	137,088.00	0.42
38	000778	新兴铸管	33,331	135,990.48	0.42
39	002002	鸿达兴业	60,400	135,296.00	0.42
40	000156	华数传媒	15,500	134,850.00	0.42
41	300850	新强联	3,600	134,568.00	0.41
42	002156	通富微电	5,900	133,340.00	0.41

43	600197	伊力特	4,900	133,133.00	0.41
44	600177	雅戈尔	20,800	131,248.00	0.40
45	600728	佳都科技	18,500	128,205.00	0.40
46	000860	顺鑫农业	3,800	128,022.00	0.39
47	002092	中泰化学	19,800	127,710.00	0.39
48	688819	天能股份	3,461	127,503.24	0.39
49	600350	山东高速	19,994	127,361.78	0.39
50	002223	鱼跃医疗	3,500	125,965.00	0.39
51	002832	比音勒芬	3,512	124,359.92	0.38
52	600820	隧道股份	20,400	122,604.00	0.38
53	601228	广州港	37,600	121,448.00	0.37
54	002930	宏川智慧	5,300	120,681.00	0.37
55	600129	太极集团	2,000	118,980.00	0.37
56	600755	厦门国贸	15,200	117,648.00	0.36
57	000739	普洛药业	6,500	115,310.00	0.36
58	603179	新泉股份	2,624	115,167.36	0.35
59	600023	浙能电力	22,700	115,089.00	0.35
60	600612	老凤祥	1,629	113,834.52	0.35
61	002465	海格通信	10,959	113,316.06	0.35
62	603728	鸣志电器	1,400	112,420.00	0.35
63	003006	百亚股份	6,300	108,864.00	0.34
64	002389	航天彩虹	4,900	108,829.00	0.34
65	688208	道通科技	3,583	108,600.73	0.33
66	002126	银轮股份	6,053	107,138.10	0.33
67	300957	贝泰妮	1,200	106,656.00	0.33
68	600521	华海药业	5,700	104,937.00	0.32
69	600109	国金证券	12,100	104,907.00	0.32
70	603456	九洲药业	3,800	104,044.00	0.32
71	002746	仙坛股份	13,072	103,007.36	0.32
72	600363	联创光电	2,700	100,170.00	0.31
73	300118	东方日升	3,900	99,957.00	0.31
74	600909	华安证券	21,127	98,663.09	0.30
75	688088	虹软科技	2,301	98,367.75	0.30
76	300433	蓝思科技	8,300	97,608.00	0.30
77	600487	亨通光电	6,500	95,290.00	0.29
78	002612	朗姿股份	4,000	95,120.00	0.29
79	300702	天宇股份	3,900	94,653.00	0.29
80	601058	赛轮轮胎	8,274	94,240.86	0.29
81	002438	江苏神通	8,100	92,988.00	0.29
82	002990	盛视科技	2,500	92,000.00	0.28
83	300747	锐科激光	3,000	91,440.00	0.28
84	603959	百利科技	7,900	90,850.00	0.28
85	002739	万达电影	7,200	90,288.00	0.28

86	600398	海澜之家	12,900	88,752.00	0.27
87	603345	安井食品	600	88,080.00	0.27
88	002283	天润工业	13,700	87,954.00	0.27
89	000967	盈峰环境	17,100	86,355.00	0.27
90	000898	鞍钢股份	30,700	85,346.00	0.26
91	600298	安琪酵母	2,344	84,876.24	0.26
92	601333	广深铁路	20,700	81,972.00	0.25
93	600096	云天化	4,800	81,936.00	0.25
94	688029	南微医学	1,001	81,641.56	0.25
95	603197	保隆科技	1,500	81,375.00	0.25
96	002641	公元股份	14,400	81,216.00	0.25
97	603883	老百姓	2,705	80,744.25	0.25
98	603899	晨光股份	1,800	80,352.00	0.25
99	300232	洲明科技	8,735	79,837.90	0.25
100	000528	柳 工	10,100	79,790.00	0.25
101	603228	景旺电子	3,100	79,515.00	0.25
102	603688	石英股份	695	79,118.80	0.24
103	002212	天融信	8,100	78,570.00	0.24
104	688526	科前生物	3,237	77,008.23	0.24
105	002568	百润股份	2,100	76,335.00	0.24
106	603233	大参林	2,710	75,907.10	0.23
107	600968	海油发展	24,586	75,479.02	0.23
108	603313	梦百合	7,500	75,225.00	0.23
109	603218	日月股份	3,946	74,934.54	0.23
110	688617	惠泰医疗	200	74,750.00	0.23
111	002747	埃斯顿	2,600	72,800.00	0.22
112	600143	金发科技	8,300	72,459.00	0.22
113	600827	百联股份	5,400	72,198.00	0.22
114	600688	上海石化	23,200	72,152.00	0.22
115	300438	鹏辉能源	1,500	72,060.00	0.22
116	600038	中直股份	1,800	71,676.00	0.22
117	601600	中国铝业	13,000	71,370.00	0.22
118	300634	彩讯股份	2,700	71,280.00	0.22
119	600161	天坛生物	2,600	70,590.00	0.22
120	002233	塔牌集团	9,100	70,252.00	0.22
121	301039	中集车辆	5,300	70,119.00	0.22
122	600323	瀚蓝环境	3,700	70,041.00	0.22
123	000069	华侨城 A	15,800	69,520.00	0.21
124	301155	海力风电	900	69,372.00	0.21
125	002563	森马服饰	11,100	69,042.00	0.21
126	600166	福田汽车	20,300	69,020.00	0.21
127	601108	财通证券	9,500	68,780.00	0.21
128	002803	吉宏股份	3,347	68,479.62	0.21

129	300454	深信服	600	67,950.00	0.21
130	002299	圣农发展	3,531	67,618.65	0.21
131	002155	湖南黄金	5,500	67,100.00	0.21
132	601577	长沙银行	8,600	66,736.00	0.21
133	002600	领益智造	9,600	66,336.00	0.20
134	603279	景津装备	2,100	65,856.00	0.20
135	002518	科士达	1,626	65,056.26	0.20
136	002138	顺络电子	2,700	64,557.00	0.20
137	002987	京北方	2,943	64,510.56	0.20
138	301087	可孚医疗	1,300	64,090.00	0.20
139	000960	锡业股份	4,100	63,755.00	0.20
140	603605	珀莱雅	566	63,618.40	0.20
141	600933	爱柯迪	2,705	62,999.45	0.19
142	002675	东诚药业	4,240	62,370.40	0.19
143	002345	潮宏基	7,900	62,094.00	0.19
144	300144	宋城演艺	5,006	62,074.40	0.19
145	002385	大北农	9,400	62,040.00	0.19
146	600377	宁沪高速	6,274	61,673.42	0.19
147	603306	华懋科技	2,122	61,580.44	0.19
148	603997	继峰股份	4,300	61,490.00	0.19
149	601168	西部矿业	5,830	61,273.30	0.19
150	600765	中航重机	2,306	61,132.06	0.19
151	600201	生物股份	6,400	60,864.00	0.19
152	600400	红豆股份	18,500	60,680.00	0.19
153	002926	华西证券	7,300	60,663.00	0.19
154	300855	图南股份	1,717	60,644.44	0.19
155	603156	养元饮品	2,454	60,613.80	0.19
156	600808	马钢股份	23,522	60,451.54	0.19
157	300258	精锻科技	4,100	59,409.00	0.18
158	688711	宏微科技	1,013	59,098.42	0.18
159	601222	林洋能源	7,200	58,968.00	0.18
160	000333	美的集团	1,000	58,920.00	0.18
161	002050	三花智控	1,866	56,465.16	0.17
162	601869	长飞光纤	1,520	56,255.20	0.17
163	002670	国盛金控	6,400	56,192.00	0.17
164	603160	汇顶科技	1,200	55,500.00	0.17
165	600597	光明乳业	5,300	55,120.00	0.17
166	600580	卧龙电驱	3,751	54,802.11	0.17
167	601311	骆驼股份	5,900	54,752.00	0.17
168	002131	利欧股份	23,800	54,740.00	0.17
169	601208	东材科技	4,300	54,610.00	0.17
170	301031	中熔电气	400	54,284.00	0.17
171	603960	克来机电	2,900	54,085.00	0.17

172	600297	广汇汽车	25,500	53,040.00	0.16
173	300421	力星股份	4,440	53,013.60	0.16
174	601567	三星医疗	4,172	52,692.36	0.16
175	002185	华天科技	5,700	52,440.00	0.16
176	600546	山煤国际	3,600	52,092.00	0.16
177	000786	北新建材	2,100	51,471.00	0.16
178	000921	海信家电	1,900	51,205.00	0.16
179	000030	富奥股份	10,083	50,818.32	0.16
180	601607	上海医药	2,261	50,669.01	0.16
181	688676	金盘科技	1,659	50,251.11	0.15
182	688097	博众精工	1,644	49,911.84	0.15
183	301168	通灵股份	800	49,840.00	0.15
184	301101	明月镜片	1,200	49,236.00	0.15
185	002743	富煌钢构	8,500	48,875.00	0.15
186	002922	伊戈尔	3,400	48,790.00	0.15
187	603129	春风动力	300	48,570.00	0.15
188	002179	中航光电	1,061	48,116.35	0.15
189	000028	国药一致	1,100	47,971.00	0.15
190	601865	福莱特	1,234	47,521.34	0.15
191	002056	横店东磁	2,600	47,346.00	0.15
192	688006	杭可科技	1,553	47,319.91	0.15
193	300856	科思股份	600	47,262.00	0.15
194	300450	先导智能	1,300	47,021.00	0.14
195	688390	固德威	280	46,720.80	0.14
196	300827	上能电气	1,286	46,360.30	0.14
197	300443	金雷股份	1,300	46,085.00	0.14
198	002698	博实股份	2,600	45,474.00	0.14
199	000683	远兴能源	6,300	45,297.00	0.14
200	002444	巨星科技	2,070	45,291.60	0.14
201	603043	广州酒家	1,600	45,216.00	0.14
202	002919	名臣健康	1,000	45,100.00	0.14
203	603298	杭叉集团	1,913	45,051.15	0.14
204	001289	龙源电力	2,000	45,000.00	0.14
205	300228	富瑞特装	7,000	44,800.00	0.14
206	002478	常宝股份	6,000	44,700.00	0.14
207	603699	纽威股份	2,995	44,565.60	0.14
208	605388	均瑶健康	3,500	44,485.00	0.14
209	002906	华阳集团	1,301	44,481.19	0.14
210	600011	华能国际	4,800	44,448.00	0.14
211	601966	玲珑轮胎	2,000	44,440.00	0.14
212	002532	天山铝业	7,400	44,326.00	0.14
213	601888	中国中免	400	44,212.00	0.14
214	003000	劲仔食品	3,500	44,065.00	0.14

215	002984	森麒麟	1,400	44,044.00	0.14
216	603319	湘油泵	2,600	44,018.00	0.14
217	603737	三棵树	668	43,700.56	0.13
218	600315	上海家化	1,500	43,515.00	0.13
219	605300	佳禾食品	2,000	43,480.00	0.13
220	600681	百川能源	9,300	43,431.00	0.13
221	600335	国机汽车	3,800	43,320.00	0.13
222	600862	中航高科	1,700	43,027.00	0.13
223	301047	义翘神州	500	42,850.00	0.13
224	601890	亚星锚链	3,700	42,846.00	0.13
225	300389	艾比森	2,100	42,777.00	0.13
226	603686	福龙马	4,100	42,763.00	0.13
227	603283	赛腾股份	956	42,542.00	0.13
228	300990	同飞股份	840	42,252.00	0.13
229	688358	祥生医疗	828	42,228.00	0.13
230	002595	豪迈科技	1,200	42,156.00	0.13
231	000951	中国重汽	2,501	42,141.85	0.13
232	002616	长青集团	8,225	42,112.00	0.13
233	605368	蓝天燃气	4,400	42,108.00	0.13
234	002959	小熊电器	500	41,750.00	0.13
235	688777	中控技术	664	41,685.92	0.13
236	300349	金卡智能	3,000	41,640.00	0.13
237	603878	武进不锈	4,920	41,574.00	0.13
238	600418	江淮汽车	3,300	41,547.00	0.13
239	000550	江铃汽车	3,000	41,520.00	0.13
240	688050	爱博医疗	202	41,476.66	0.13
241	603303	得邦照明	3,000	41,430.00	0.13
242	300937	药易购	1,300	41,327.00	0.13
243	300346	南大光电	1,200	41,268.00	0.13
244	300815	玉禾田	2,759	41,053.92	0.13
245	002006	精工科技	1,900	40,983.00	0.13
246	300119	瑞普生物	2,300	40,940.00	0.13
247	000407	胜利股份	11,200	40,880.00	0.13
248	603328	依顿电子	4,923	40,762.44	0.13
249	603977	国泰集团	4,700	40,702.00	0.13
250	603239	浙江仙通	2,500	40,675.00	0.13
251	002029	七匹狼	6,400	40,640.00	0.13
252	603706	东方环宇	2,700	40,635.00	0.13
253	688366	昊海生科	482	40,594.04	0.13
254	000599	青岛双星	9,500	40,565.00	0.13
255	600795	国电电力	10,587	40,548.21	0.12
256	603871	嘉友国际	2,579	40,516.09	0.12
257	600886	国投电力	3,200	40,480.00	0.12

258	600872	中炬高新	1,100	40,469.00	0.12
259	001205	盛航股份	1,900	40,318.00	0.12
260	603017	中衡设计	3,700	40,293.00	0.12
261	300898	熊猫乳品	1,800	40,284.00	0.12
262	300511	雪榕生物	5,300	40,280.00	0.12
263	603027	千禾味业	1,900	40,128.00	0.12
264	000913	钱江摩托	2,200	40,106.00	0.12
265	603919	金徽酒	1,700	39,916.00	0.12
266	603608	天创时尚	8,600	39,904.00	0.12
267	001215	千味央厨	600	39,894.00	0.12
268	603839	安正时尚	5,300	39,856.00	0.12
269	603985	恒润股份	1,900	39,843.00	0.12
270	605339	南侨食品	2,000	39,820.00	0.12
271	002221	东华能源	4,600	39,790.00	0.12
272	300428	立中集团	1,725	39,778.50	0.12
273	300882	万胜智能	1,400	39,732.00	0.12
274	002697	红旗连锁	6,800	39,712.00	0.12
275	600901	江苏金租	9,607	39,676.91	0.12
276	603596	伯特利	500	39,630.00	0.12
277	002727	一心堂	1,500	39,600.00	0.12
278	000501	武商集团	4,000	39,560.00	0.12
279	300871	回盛生物	2,400	39,552.00	0.12
280	600750	江中药业	1,800	39,474.00	0.12
281	002983	芯瑞达	1,600	39,472.00	0.12
282	300857	协创数据	1,500	39,420.00	0.12
283	601728	中国电信	7,000	39,410.00	0.12
284	600763	通策医疗	400	38,744.00	0.12
285	603103	横店影视	2,300	38,732.00	0.12
286	002459	晶澳科技	920	38,364.00	0.12
287	300285	国瓷材料	1,400	38,360.00	0.12
288	002991	甘源食品	500	38,350.00	0.12
289	603730	岱美股份	2,415	38,157.00	0.12
290	300408	三环集团	1,300	38,155.00	0.12
291	002956	西麦食品	2,432	38,012.16	0.12
292	603199	九华旅游	1,100	38,005.00	0.12
293	688188	柏楚电子	200	37,712.00	0.12
294	600138	中青旅	3,000	37,530.00	0.12
295	601007	金陵饭店	4,400	37,488.00	0.12
296	002028	思源电气	800	37,376.00	0.12
297	600941	中国移动	400	37,320.00	0.12
298	600419	天润乳业	2,300	37,306.00	0.11
299	601688	华泰证券	2,700	37,179.00	0.11
300	603309	维力医疗	2,400	37,128.00	0.11

301	601318	中国平安	800	37,120.00	0.11
302	600282	南钢股份	11,000	37,070.00	0.11
303	002244	滨江集团	4,185	36,911.70	0.11
304	688212	澳华内镜	543	36,869.70	0.11
305	002511	中顺洁柔	3,300	36,795.00	0.11
306	300737	科顺股份	4,000	36,640.00	0.11
307	603308	应流股份	2,000	36,600.00	0.11
308	688387	信科移动	4,371	36,497.85	0.11
309	603187	海容冷链	1,820	36,381.80	0.11
310	300037	新宙邦	700	36,323.00	0.11
311	688533	上声电子	777	36,309.21	0.11
312	300627	华测导航	1,100	35,717.00	0.11
313	688009	中国通号	6,126	35,530.80	0.11
314	002895	川恒股份	1,800	35,460.00	0.11
315	688023	安恒信息	200	34,942.00	0.11
316	605499	东鹏饮料	200	34,580.00	0.11
317	002353	杰瑞股份	1,368	34,377.84	0.11
318	002544	普天科技	1,500	34,350.00	0.11
319	300973	立高食品	500	34,210.00	0.11
320	601928	凤凰传媒	3,000	34,200.00	0.11
321	601668	中国建筑	5,931	34,043.94	0.10
322	600967	内蒙一机	3,275	33,077.50	0.10
323	000630	铜陵有色	11,400	32,946.00	0.10
324	600938	中国海油	1,800	32,616.00	0.10
325	605020	永和股份	1,260	32,520.60	0.10
326	002624	完美世界	1,900	32,091.00	0.10
327	300136	信维通信	1,584	31,806.72	0.10
328	002371	北方华创	100	31,765.00	0.10
329	600663	陆家嘴	3,200	31,584.00	0.10
330	601012	隆基绿能	1,100	31,537.00	0.10
331	688122	西部超导	560	31,208.80	0.10
332	600655	豫园股份	4,498	30,856.28	0.10
333	002110	三钢闽光	7,200	30,384.00	0.09
334	601319	中国人保	5,200	30,368.00	0.09
335	000089	深圳机场	4,312	29,968.40	0.09
336	600188	兖矿能源	1,000	29,920.00	0.09
337	600028	中国石化	4,700	29,892.00	0.09
338	600999	招商证券	2,200	29,854.00	0.09
339	601988	中国银行	7,600	29,716.00	0.09
340	600754	锦江酒店	700	29,638.00	0.09
341	002236	大华股份	1,500	29,625.00	0.09
342	603501	韦尔股份	300	29,412.00	0.09
343	601231	环旭电子	1,965	29,396.40	0.09

344	601658	邮储银行	6,000	29,340.00	0.09
345	000738	航发控制	1,200	29,280.00	0.09
346	000636	风华高科	1,900	29,146.00	0.09
347	300070	碧水源	5,400	28,944.00	0.09
348	600276	恒瑞医药	600	28,740.00	0.09
349	601601	中国太保	1,100	28,578.00	0.09
350	300451	创业慧康	3,400	28,492.00	0.09
351	688385	复旦微电	567	28,406.70	0.09
352	688408	中信博	336	28,334.88	0.09
353	600587	新华医疗	800	28,264.00	0.09
354	601456	国联证券	3,100	28,210.00	0.09
355	002456	欧菲光	5,000	28,000.00	0.09
356	688318	财富趋势	280	27,991.60	0.09
357	002049	紫光国微	300	27,975.00	0.09
358	603466	风语筑	2,000	27,800.00	0.09
359	002859	洁美科技	1,000	27,700.00	0.09
360	600050	中国联通	5,700	27,360.00	0.08
361	603508	思维列控	1,600	27,280.00	0.08
362	600801	华新水泥	2,200	27,170.00	0.08
363	002430	杭氧股份	781	26,835.16	0.08
364	300705	九典制药	1,000	26,430.00	0.08
365	601111	中国国航	3,200	26,368.00	0.08
366	000858	五粮液	161	26,334.77	0.08
367	002701	奥瑞金	5,800	26,158.00	0.08
368	002929	润建股份	600	26,046.00	0.08
369	002153	石基信息	1,820	25,480.00	0.08
370	600029	南方航空	4,200	25,326.00	0.08
371	002273	水晶光电	2,098	25,050.12	0.08
372	601666	平煤股份	3,300	24,882.00	0.08
373	601611	中国核建	2,900	24,505.00	0.08
374	600845	宝信软件	480	24,388.80	0.08
375	600079	人福医药	900	24,246.00	0.07
376	002203	海亮股份	2,010	24,140.10	0.07
377	000009	中国宝安	2,000	24,140.00	0.07
378	600977	中国电影	1,700	23,885.00	0.07
379	600348	华阳股份	3,000	23,730.00	0.07
380	301011	华立科技	1,000	23,430.00	0.07
381	300274	阳光电源	200	23,326.00	0.07
382	002531	天顺风能	1,500	22,845.00	0.07
383	000063	中兴通讯	500	22,770.00	0.07
384	600588	用友网络	1,100	22,550.00	0.07
385	688066	航天宏图	367	22,350.30	0.07
386	600141	兴发集团	1,000	22,220.00	0.07

387	600985	淮北矿业	1,916	22,072.32	0.07
388	601336	新华保险	600	22,062.00	0.07
389	002475	立讯精密	678	22,001.10	0.07
390	601618	中国中冶	5,500	21,835.00	0.07
391	000963	华东医药	500	21,685.00	0.07
392	603290	斯达半导	100	21,520.00	0.07
393	688167	炬光科技	200	21,510.00	0.07
394	002254	泰和新材	879	21,509.13	0.07
395	688375	国博电子	270	21,384.00	0.07
396	300036	超图软件	900	21,339.00	0.07
397	600919	江苏银行	2,900	21,315.00	0.07
398	002653	海思科	900	21,240.00	0.07
399	000568	泸州老窖	101	21,166.57	0.07
400	002027	分众传媒	3,100	21,111.00	0.07
401	600583	海油工程	3,600	21,060.00	0.06
402	603127	昭衍新药	505	20,654.50	0.06
403	002180	纳思达	600	20,550.00	0.06
404	601098	中南传媒	1,768	20,508.80	0.06
405	601899	紫金矿业	1,800	20,466.00	0.06
406	603885	吉祥航空	1,300	20,059.00	0.06
407	601233	桐昆股份	1,500	19,875.00	0.06
408	002837	英维克	662	19,820.28	0.06
409	603589	口子窖	400	19,740.00	0.06
410	601186	中国铁建	2,000	19,700.00	0.06
411	603505	金石资源	840	19,614.00	0.06
412	603267	鸿远电子	300	19,590.00	0.06
413	000048	京基智农	1,000	19,520.00	0.06
414	300383	光环新网	1,800	19,350.00	0.06
415	600391	航发科技	800	19,288.00	0.06
416	000733	振华科技	200	19,170.00	0.06
417	600885	宏发股份	600	19,110.00	0.06
418	688295	中复神鹰	518	19,000.24	0.06
419	600362	江西铜业	1,000	18,980.00	0.06
420	600848	上海临港	1,588	18,976.60	0.06
421	600673	东阳光	2,600	18,746.00	0.06
422	000516	国际医学	2,200	18,502.00	0.06
423	600132	重庆啤酒	200	18,432.00	0.06
424	300058	蓝色光标	1,900	18,373.00	0.06
425	601717	郑煤机	1,471	18,313.95	0.06
426	300750	宁德时代	80	18,303.20	0.06
427	601126	四方股份	1,200	18,228.00	0.06
428	002276	万马股份	1,500	18,165.00	0.06
429	000799	酒鬼酒	200	18,030.00	0.06

430	300474	景嘉微	200	17,998.00	0.06
431	002011	盾安环境	1,300	17,979.00	0.06
432	000403	派林生物	900	17,964.00	0.06
433	600536	中国软件	380	17,814.40	0.05
434	002775	文科园林	4,700	17,625.00	0.05
435	300033	同花顺	100	17,528.00	0.05
436	002410	广联达	538	17,479.62	0.05
437	000685	中山公用	2,300	17,411.00	0.05
438	600516	方大炭素	2,800	17,360.00	0.05
439	600085	同仁堂	300	17,268.00	0.05
440	002324	普利特	1,200	17,124.00	0.05
441	600887	伊利股份	600	16,992.00	0.05
442	300751	迈为股份	100	16,938.00	0.05
443	601898	中煤能源	2,000	16,880.00	0.05
444	688099	晶晨股份	200	16,864.00	0.05
445	600219	南山铝业	5,500	16,610.00	0.05
446	300693	盛弘股份	448	16,540.16	0.05
447	000761	本钢板材	4,100	16,400.00	0.05
448	002966	苏州银行	2,500	16,375.00	0.05
449	688268	华特气体	200	16,146.00	0.05
450	002266	浙富控股	3,900	16,107.00	0.05
451	002867	周大生	900	16,002.00	0.05
452	600549	厦门钨业	834	15,871.02	0.05
453	002367	康力电梯	1,700	15,521.00	0.05
454	601088	中国神华	500	15,375.00	0.05
455	002250	联化科技	1,455	15,219.30	0.05
456	600378	昊华科技	400	15,056.00	0.05
457	601991	大唐发电	4,500	14,895.00	0.05
458	300308	中际旭创	101	14,892.45	0.05
459	688218	江苏北人	675	14,856.75	0.05
460	000157	中联重科	2,200	14,850.00	0.05
461	000555	神州信息	1,200	14,760.00	0.05
462	002683	广东宏大	500	14,720.00	0.05
463	603363	傲农生物	1,600	14,672.00	0.05
464	300416	苏试试验	680	14,660.80	0.05
465	600500	中化国际	2,635	14,650.60	0.05
466	000016	深康佳 A	3,100	14,632.00	0.05
467	300034	钢研高纳	371	14,613.69	0.05
468	300803	指南针	300	14,577.00	0.04
469	600803	新奥股份	766	14,538.68	0.04
470	600390	五矿资本	2,700	14,526.00	0.04
471	000707	双环科技	1,700	14,450.00	0.04
472	603041	美思德	1,200	14,424.00	0.04

473	002602	世纪华通	1,900	14,421.00	0.04
474	688521	芯原股份	200	14,384.00	0.04
475	002372	伟星新材	700	14,378.00	0.04
476	002080	中材科技	700	14,364.00	0.04
477	300531	优博讯	1,000	14,140.00	0.04
478	300457	赢合科技	800	14,128.00	0.04
479	002967	广电计量	700	14,063.00	0.04
480	600027	华电国际	2,100	14,049.00	0.04
481	603260	合盛硅业	200	14,004.00	0.04
482	002673	西部证券	2,200	13,970.00	0.04
483	600861	北京人力	600	13,920.00	0.04
484	601828	美凯龙	2,900	13,891.00	0.04
485	601877	正泰电器	500	13,825.00	0.04
486	002434	万里扬	1,500	13,425.00	0.04
487	002588	史丹利	2,200	13,376.00	0.04
488	002985	北摩高科	302	13,324.24	0.04
489	600567	山鹰国际	5,800	13,282.00	0.04
490	600900	长江电力	600	13,236.00	0.04
491	600195	中牧股份	1,124	13,128.32	0.04
492	002655	共达电声	1,000	12,990.00	0.04
493	601636	旗滨集团	1,500	12,930.00	0.04
494	300414	中光防雷	1,300	12,870.00	0.04
495	300498	温氏股份	700	12,845.00	0.04
496	000717	中南股份	4,600	12,788.00	0.04
497	300088	长信科技	2,117	12,765.51	0.04
498	600060	海信视像	514	12,721.50	0.04
499	600483	福能股份	1,100	12,705.00	0.04
500	601857	中国石油	1,700	12,699.00	0.04
501	000709	河钢股份	5,594	12,642.44	0.04
502	603989	艾华集团	600	12,636.00	0.04
503	301103	何氏眼科	300	12,588.00	0.04
504	002463	沪电股份	600	12,564.00	0.04
505	000800	一汽解放	1,500	12,555.00	0.04
506	603639	海利尔	700	12,544.00	0.04
507	601808	中海油服	900	12,492.00	0.04
508	002368	太极股份	300	12,351.00	0.04
509	600559	老白干酒	500	12,255.00	0.04
510	002081	金螳螂	2,700	12,177.00	0.04
511	300558	贝达药业	252	12,103.56	0.04
512	603368	柳药集团	488	12,058.48	0.04
513	300015	爱尔眼科	650	12,057.50	0.04
514	002936	郑州银行	5,200	11,960.00	0.04
515	002439	启明星辰	400	11,904.00	0.04

516	600211	西藏药业	200	11,880.00	0.04
517	688011	新光光电	460	11,877.20	0.04
518	600782	新钢股份	3,200	11,872.00	0.04
519	002831	裕同科技	484	11,804.76	0.04
520	002397	梦洁股份	3,400	11,798.00	0.04
521	601696	中银证券	1,100	11,726.00	0.04
522	601908	京运通	1,935	11,706.75	0.04
523	300210	森远股份	3,800	11,704.00	0.04
524	002391	长青股份	1,700	11,679.00	0.04
525	300900	广联航空	400	11,524.00	0.04
526	600461	洪城环境	1,400	11,438.00	0.04
527	300638	广和通	500	11,340.00	0.03
527	603778	乾景园林	2,100	11,340.00	0.03
528	603496	恒为科技	600	11,268.00	0.03
529	603993	洛阳钼业	2,100	11,193.00	0.03
530	600837	海通证券	1,200	11,064.00	0.03
531	002635	安洁科技	800	11,040.00	0.03
532	300590	移为通信	900	10,998.00	0.03
533	600577	精达股份	2,600	10,972.00	0.03
534	300315	掌趣科技	1,400	10,920.00	0.03
535	000975	银泰黄金	932	10,904.40	0.03
536	300633	开立医疗	200	10,900.00	0.03
537	300078	思创医惠	2,400	10,800.00	0.03
538	300137	先河环保	1,900	10,754.00	0.03
539	002176	江特电机	900	10,728.00	0.03
540	300661	圣邦股份	130	10,676.90	0.03
541	688234	天岳先进	144	10,647.36	0.03
542	601939	建设银行	1,700	10,642.00	0.03
543	603825	华扬联众	800	10,632.00	0.03
544	600771	广誉远	300	10,581.00	0.03
545	600361	创新新材	2,200	10,560.00	0.03
546	000538	云南白药	200	10,496.00	0.03
547	002242	九阳股份	700	10,465.00	0.03
548	601872	招商轮船	1,800	10,422.00	0.03
549	300763	锦浪科技	100	10,410.00	0.03
550	001872	招商港口	600	10,362.00	0.03
551	600360	华微电子	1,500	10,320.00	0.03
551	603136	天目湖	400	10,320.00	0.03
552	300219	鸿利智汇	1,400	10,290.00	0.03
553	300319	麦捷科技	1,200	10,272.00	0.03
554	600456	宝钛股份	300	10,152.00	0.03
555	000959	首钢股份	2,900	10,150.00	0.03
556	600000	浦发银行	1,400	10,136.00	0.03

557	601818	光大银行	3,300	10,131.00	0.03
558	603877	太平鸟	400	10,112.00	0.03
559	002174	游族网络	600	10,080.00	0.03
560	300043	星辉娱乐	2,700	10,071.00	0.03
561	300073	当升科技	200	10,066.00	0.03
562	600183	生益科技	700	9,940.00	0.03
563	000032	深桑达 A	300	9,870.00	0.03
564	600036	招商银行	300	9,828.00	0.03
565	603385	惠达卫浴	1,300	9,789.00	0.03
566	300685	艾德生物	400	9,704.00	0.03
567	300782	卓胜微	100	9,663.00	0.03
568	300648	星云股份	300	9,654.00	0.03
569	300777	中简科技	204	9,641.04	0.03
570	688475	萤石网络	223	9,557.78	0.03
571	300567	精测电子	100	9,515.00	0.03
572	600757	长江传媒	1,100	9,460.00	0.03
573	300762	上海瀚讯	800	9,416.00	0.03
574	601866	中远海发	3,800	9,386.00	0.03
575	688266	泽璟制药	200	9,310.00	0.03
576	000789	万年青	1,200	9,300.00	0.03
577	603063	禾望电气	301	9,255.75	0.03
578	002765	蓝黛科技	1,100	9,196.00	0.03
579	601985	中国核电	1,300	9,165.00	0.03
580	300593	新雷能	400	9,164.00	0.03
581	600170	上海建工	3,396	9,135.24	0.03
582	002139	拓邦股份	700	9,135.00	0.03
583	600048	保利发展	700	9,121.00	0.03
584	600606	绿地控股	3,300	9,075.00	0.03
585	300586	美联新材	700	9,037.00	0.03
586	002416	爱施德	1,200	8,856.00	0.03
587	600004	白云机场	600	8,604.00	0.03
588	603595	东尼电子	200	8,564.00	0.03
589	600776	东方通信	600	8,550.00	0.03
590	002714	牧原股份	200	8,430.00	0.03
591	301227	森鹰窗业	300	8,319.00	0.03
592	002068	黑猫股份	700	8,309.00	0.03
593	603098	森特股份	400	8,200.00	0.03
594	603236	移远通信	140	8,079.40	0.02
595	300887	谱尼测试	200	7,916.00	0.02
596	601226	华电重工	1,000	7,840.00	0.02
597	301102	兆讯传媒	290	7,792.30	0.02
598	603486	科沃斯	100	7,777.00	0.02
599	300068	南都电源	400	7,744.00	0.02

600	000998	隆平高科	500	7,675.00	0.02
601	603659	璞泰来	200	7,644.00	0.02
602	002508	老板电器	300	7,587.00	0.02
603	601138	工业富联	300	7,560.00	0.02
604	600602	云赛智联	500	7,530.00	0.02
605	002158	汉钟精机	300	7,488.00	0.02
605	300806	斯迪克	400	7,488.00	0.02
606	000338	潍柴动力	600	7,476.00	0.02
607	603185	弘元绿能	100	7,455.00	0.02
608	300636	同和药业	600	7,356.00	0.02
609	300456	赛微电子	300	7,344.00	0.02
610	605337	李子园	400	7,312.00	0.02
611	000651	格力电器	200	7,302.00	0.02
612	002019	亿帆医药	500	7,300.00	0.02
613	603317	天味食品	499	7,290.39	0.02
614	300035	中科电气	600	7,212.00	0.02
615	000155	川能动力	500	7,200.00	0.02
616	002979	雷赛智能	300	7,128.00	0.02
617	301122	采纳股份	200	7,124.00	0.02
618	601886	江河集团	800	7,112.00	0.02
619	002878	元隆雅图	400	7,096.00	0.02
620	002688	金河生物	1,500	7,080.00	0.02
621	605100	华丰股份	400	7,052.00	0.02
622	603818	曲美家居	1,300	7,020.00	0.02
623	605378	野马电池	300	6,993.00	0.02
624	002572	索菲亚	400	6,968.00	0.02
625	601328	交通银行	1,200	6,960.00	0.02
626	601677	明泰铝业	500	6,940.00	0.02
627	002549	凯美特气	600	6,900.00	0.02
628	300918	南山智尚	500	6,865.00	0.02
629	605167	利柏特	700	6,776.00	0.02
630	300952	恒辉安防	300	6,768.00	0.02
631	601615	明阳智能	400	6,752.00	0.02
632	300569	天能重工	800	6,736.00	0.02
633	001965	招商公路	700	6,720.00	0.02
634	000100	TCL 科技	1,700	6,698.00	0.02
635	600882	妙可蓝多	300	6,684.00	0.02
636	600598	北大荒	500	6,665.00	0.02
637	605303	园林股份	600	6,660.00	0.02
638	301207	华兰疫苗	200	6,652.00	0.02
638	600031	三一重工	400	6,652.00	0.02
639	300839	博汇股份	500	6,645.00	0.02
640	300122	智飞生物	150	6,630.00	0.02

641	002415	海康威视	200	6,622.00	0.02
642	300183	东软载波	400	6,604.00	0.02
643	002245	蔚蓝锂芯	600	6,570.00	0.02
644	601001	晋控煤业	700	6,552.00	0.02
645	600153	建发股份	600	6,546.00	0.02
646	000933	神火股份	500	6,500.00	0.02
647	601169	北京银行	1,400	6,482.00	0.02
648	600908	无锡银行	1,200	6,432.00	0.02
649	600285	羚锐制药	400	6,424.00	0.02
650	002484	江海股份	300	6,387.00	0.02
651	600332	白云山	200	6,376.00	0.02
652	000938	紫光股份	200	6,370.00	0.02
653	002219	新里程	1,400	6,328.00	0.02
654	600973	宝胜股份	1,300	6,305.00	0.02
655	002057	中钢天源	600	6,300.00	0.02
656	301263	泰恩康	300	6,264.00	0.02
657	300575	中旗股份	600	6,228.00	0.02
658	603811	诚意药业	500	6,215.00	0.02
659	002918	蒙娜丽莎	400	6,176.00	0.02
660	300481	濮阳惠成	300	6,168.00	0.02
661	603203	快克智能	200	6,156.00	0.02
662	603183	建研院	1,300	6,136.00	0.02
662	603958	哈森股份	800	6,136.00	0.02
663	600426	华鲁恒升	200	6,126.00	0.02
664	300203	聚光科技	300	6,081.00	0.02
665	002063	远光软件	700	6,076.00	0.02
666	600372	中航电子	400	6,072.00	0.02
667	300948	冠中生态	400	6,044.00	0.02
668	300388	节能国祯	900	6,039.00	0.02
669	001914	招商积余	400	6,020.00	0.02
670	603889	新澳股份	800	6,008.00	0.02
671	600761	安徽合力	300	5,979.00	0.02
672	000883	湖北能源	1,300	5,928.00	0.02
673	603026	胜华新材	100	5,925.00	0.02
674	300041	回天新材	500	5,900.00	0.02
675	002933	新兴装备	200	5,874.00	0.02
676	603517	绝味食品	157	5,832.55	0.02
677	000875	吉电股份	1,081	5,826.59	0.02
678	002973	侨银股份	500	5,800.00	0.02
679	002940	昂利康	300	5,763.00	0.02
680	600662	外服控股	1,000	5,720.00	0.02
681	605369	拱东医疗	100	5,604.00	0.02
682	300986	志特新材	200	5,600.00	0.02

683	600875	东方电气	300	5,595.00	0.02
684	603055	台华新材	500	5,555.00	0.02
685	002267	陕天然气	700	5,544.00	0.02
685	600888	新疆众和	700	5,544.00	0.02
686	605060	联德股份	200	5,492.00	0.02
687	300151	昌红科技	300	5,430.00	0.02
688	300026	红日药业	1,000	5,420.00	0.02
689	601179	中国西电	1,000	5,410.00	0.02
690	603786	科博达	81	5,321.70	0.02
691	603369	今世缘	100	5,280.00	0.02
692	000887	中鼎股份	400	5,236.00	0.02
693	300773	拉卡拉	300	5,232.00	0.02
694	600690	海尔智家	222	5,212.56	0.02
695	002852	道道全	400	5,172.00	0.02
696	002738	中矿资源	100	5,094.00	0.02
697	000807	云铝股份	400	5,092.00	0.02
698	300601	康泰生物	200	5,078.00	0.02
699	300767	震安科技	200	5,072.00	0.02
700	301349	信德新材	100	5,014.00	0.02
701	603520	司太立	300	5,004.00	0.02
702	300465	高伟达	500	4,965.00	0.02
703	603606	东方电缆	100	4,903.00	0.02
704	300725	药石科技	100	4,843.00	0.01
705	603939	益丰药房	129	4,773.00	0.01
706	002384	东山精密	182	4,713.80	0.01
707	600814	杭州解百	500	4,275.00	0.01
708	603237	五芳斋	140	4,246.20	0.01
709	002938	鹏鼎控股	172	4,177.88	0.01
710	300628	亿联网络	100	3,507.00	0.01
711	002394	联发股份	400	3,404.00	0.01
712	601158	重庆水务	600	3,336.00	0.01
713	300595	欧普康视	100	3,019.00	0.01
714	605009	豪悦护理	58	2,784.00	0.01
715	002271	东方雨虹	100	2,726.00	0.01
716	688350	富淼科技	157	2,667.43	0.01
717	002976	瑞玛精密	94	2,629.18	0.01
718	603171	税友股份	65	2,598.70	0.01
719	000895	双汇发展	100	2,449.00	0.01
720	300251	光线传媒	300	2,427.00	0.01
721	300684	中石科技	98	2,165.80	0.01
722	000725	京东方 A	500	2,045.00	0.01
723	603529	爱玛科技	63	2,029.86	0.01
724	600030	中信证券	100	1,978.00	0.01

725	600416	湘电股份	101	1,928.09	0.01
726	300578	会畅通讯	100	1,908.00	0.01
727	600481	双良节能	126	1,761.48	0.01
728	603305	旭升集团	53	1,477.11	0.00
729	600021	上海电力	127	1,367.79	0.00
730	605108	同庆楼	40	1,336.00	0.00
731	601298	青岛港	152	1,059.44	0.00
732	600643	爱建集团	200	1,000.00	0.00
733	600383	金地集团	100	721.00	0.00
734	002036	联创电子	69	669.99	0.00
735	300506	名家汇	100	607.00	0.00
736	000012	南 坡 A	71	423.16	0.00
737	603612	索通发展	23	398.59	0.00
738	002127	南极电商	100	383.00	0.00
739	600098	广州发展	56	346.08	0.00
740	601187	厦门银行	37	185.74	0.00
741	688187	时代电气	4	167.44	0.00
742	688315	诺禾致源	6	159.30	0.00
743	600160	巨化股份	7	96.46	0.00
744	603100	川仪股份	2	77.72	0.00
745	600114	东睦股份	5	38.10	0.00
746	002129	TCL 中环	1	33.20	0.00
747	300398	飞凯材料	1	17.19	0.00
748	300752	隆利科技	1	17.03	0.00
749	000708	中信特钢	1	15.84	0.00
750	300925	法本信息	1	14.13	0.00
751	600392	盛和资源	1	12.87	0.00
752	002645	华宏科技	1	12.26	0.00
753	002822	中装建设	1	4.14	0.00
754	000552	甘肃能化	1	3.33	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	600879	航天电子	665,574.00	1.22
2	688185	康希诺	583,474.10	1.07
3	002422	科伦药业	576,001.00	1.06
4	002673	西部证券	571,744.00	1.05
5	002465	海格通信	561,908.00	1.03
6	600728	佳都科技	553,240.00	1.02
7	601231	环旭电子	549,676.00	1.01
8	600566	济川药业	548,615.00	1.01

9	002203	海亮股份	531,373.00	0.98
10	002867	周大生	517,624.00	0.95
11	600970	中材国际	502,975.00	0.93
12	300146	汤臣倍健	495,504.00	0.91
13	601699	潞安环能	494,226.00	0.91
14	002249	大洋电机	493,061.00	0.91
15	002212	天融信	485,894.00	0.89
16	300832	新产业	485,879.00	0.89
17	600398	海澜之家	475,549.00	0.87
18	600655	豫园股份	475,300.00	0.87
19	600582	天地科技	474,887.00	0.87
20	300003	乐普医疗	469,858.00	0.86

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	600160	巨化股份	814,149.80	1.50
2	601231	环旭电子	808,612.70	1.49
3	601128	常熟银行	727,810.71	1.34
4	600895	张江高科	655,538.76	1.21
5	601198	东兴证券	644,219.70	1.18
6	600755	厦门国贸	638,974.88	1.18
7	600109	国金证券	618,558.24	1.14
8	002294	信立泰	610,174.48	1.12
9	600909	华安证券	600,952.26	1.11
10	600967	内蒙一机	600,296.98	1.10
11	601098	中南传媒	578,410.18	1.06
12	600739	辽宁成大	577,572.92	1.06
13	600566	济川药业	570,275.05	1.05
14	601992	金隅集团	559,830.71	1.03
15	600373	中文传媒	556,275.87	1.02
16	002081	金螳螂	552,620.58	1.02
17	002673	西部证券	550,239.00	1.01
18	600008	首创环保	548,358.64	1.01
19	688185	康希诺	542,052.33	1.00
20	601168	西部矿业	540,455.04	0.99

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	113,045,777.33
卖出股票收入（成交）总额	133,996,583.54

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	202,238.52	0.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	202,238.52	0.62

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019688	22 国债 23	2,000	202,238.52	0.62

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	12,893.52
2	应收清算款	57,813.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,525.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,232.65

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）	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	277	70,981.02	15,653,463.00	79.61	4,008,279.79	20.39

配置混合发起式 A						
银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	694	2,490.05	-	-	1,728,097.40	100.00
合计	971	22,028.67	15,653,463.00	73.18	5,736,377.19	26.82

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	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	665,574.65	3.39
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	19,519.77	1.13
	合计	685,094.42	3.20

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	-
	合计	0~10
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	10~50
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	-
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,400.14	46.76	10,001,400.14	46.76	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	46.76	10,001,400.14	46.76	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日 (2017 年 12 月 15 日) 基金份额总额	13,175,905.27	1,086,315.48
本报告期期初基金 份额总额	22,648,637.44	14,707,218.60
本报告期基金总申 购份额	1,212,653.93	1,155,934.15
减: 本报告期基金总 赎回份额	4,199,548.58	14,135,055.35
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	19,661,742.79	1,728,097.40

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 (%)	
东方财富	7	246,954,054.07	100	57,120.48	100	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2					
广发证券	2					
联储证券	1					新增 1个 交易 单元
世纪证券	2					新增 2个 交易 单元
华西证券	2					
开源证券	2					
平安证券	2					
天风证券	2					
西南证券	1					

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东方财富	199,358.00	100.00	-	-	-	-

爱建证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证	-	-	-	-	-	-

券						
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

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	《银华稳健增利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	《银华稳健增利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	《银华稳健增利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

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	20230101-20230103	13,477,997.16	0.00	13,477,997.16	0.00	0.00
	2	20230101-20230630	10,001,400.14	0.00	0.00	10,001,400.14	46.76
	3	20230104-20230630	5,652,062.86	0.00	0.00	5,652,062.86	26.42

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。

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 银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2023 年 8 月 29 日