

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券
投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	21
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	21
§ 6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息	22
6.2 审计报告的基本内容	22
§ 7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	25
7.3 净资产变动表	26
7.4 报表附注	28
§ 8 投资组合报告	54

8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	75
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	76
§ 10 开放式基金份额变动	76
§ 11 重大事件揭示	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	81
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	82
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 13 备查文件目录	83
13.1 备查文件目录	83
13.2 存放地点	83
13.3 查阅方式	83

§ 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	27,392,522.69 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	17,993,920.11 份	9,398,602.58 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
本期已实现收益	-2,381,521.65	-373,401.66	-5,032,900.32	-489,345.97	45,285,346.32	797,899.58
本期利润	-1,708,282.96	166,468.25	-6,339,287.73	-1,034,741.30	3,784,052.02	372,959.36

加权平均基金份额本期利润	-0.0894	0.0890	-0.3229	-0.5027	0.0258	0.3170
本期加权平均净值利润率	-6.02%	6.10%	-20.84%	-33.46%	1.80%	19.18%
本期基金份额净值增长率	-6.69%	-7.02%	-17.99%	-18.28%	27.10%	26.66%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	6,593,770.32	3,200,321.88	10,514,684.99	6,496,438.19	14,587,650.67	1,190,375.01
期末可供分配基金份额利润	0.3664	0.3405	0.4643	0.4417	0.7855	0.7642
期末基金资产净值	24,587,690.43	12,598,924.46	33,163,322.43	21,203,656.79	33,157,662.37	2,748,052.22
期末基金份额净值	1.3664	1.3405	1.4643	1.4417	1.7855	1.7642
3.1.3 累计期末指	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

标						
基金份额累计净值增长率	36.64%	34.05%	46.43%	44.17%	78.55%	76.42%

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
过去三个月	-4.70%	0.78%	-2.80%	0.39%	-1.90%	0.39%
过去六个月	-10.05%	0.77%	-4.86%	0.41%	-5.19%	0.36%
过去一年	-6.69%	0.72%	-4.34%	0.40%	-2.35%	0.32%
过去三年	-2.73%	1.10%	-13.69%	0.53%	10.96%	0.57%
过去五年	90.17%	1.17%	13.83%	0.59%	76.34%	0.58%
自基金合同生效起至今	36.64%	1.16%	0.54%	0.60%	36.10%	0.56%

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.78%	0.78%	-2.80%	0.39%	-1.98%	0.39%

过去六个月	-10.22%	0.77%	-4.86%	0.41%	-5.36%	0.36%
过去一年	-7.02%	0.72%	-4.34%	0.40%	-2.68%	0.32%
过去三年	-3.76%	1.10%	-13.69%	0.53%	9.93%	0.57%
过去五年	86.99%	1.17%	13.83%	0.59%	73.16%	0.58%
自基金合同生效 起至今	34.05%	1.16%	0.54%	0.60%	33.51%	0.56%

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%

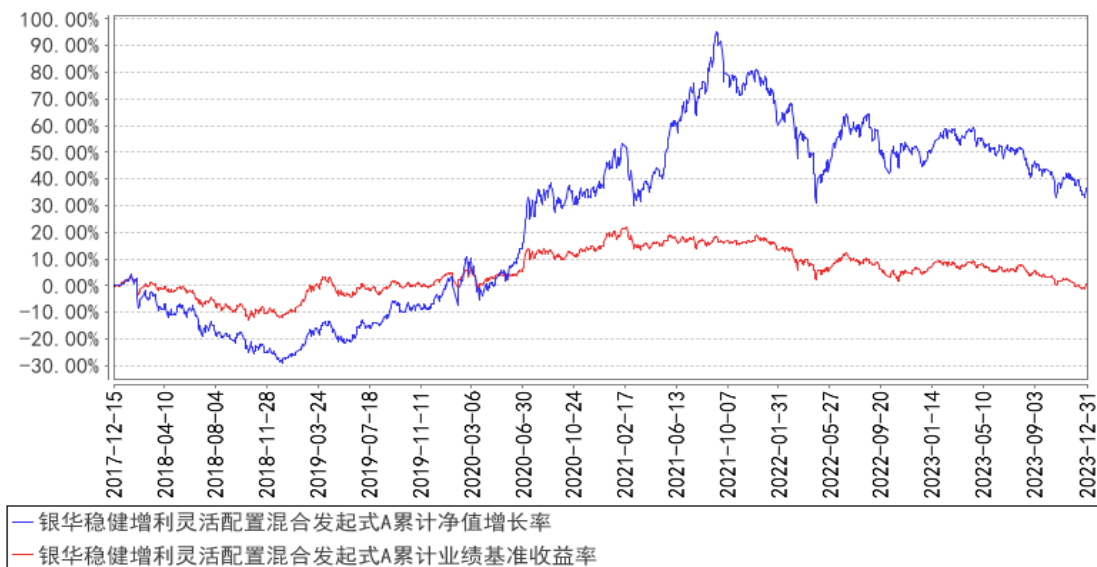
中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 800 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模居前、流动性良好的股票，目前中证 800 指数样本覆盖了沪深市场近八成左右的市值，综合反映沪深证券市场上大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性。

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。

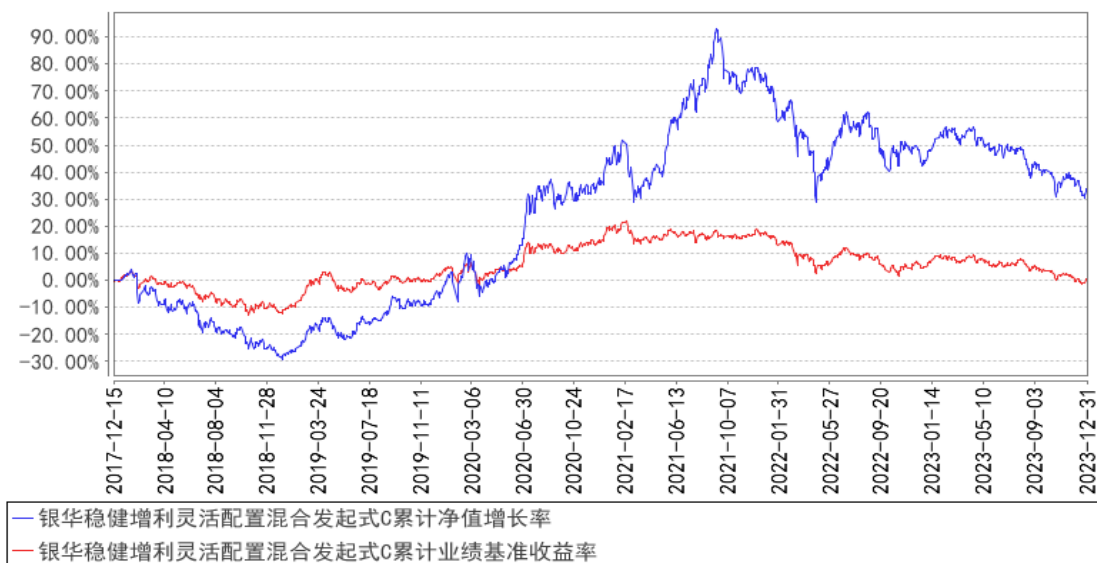
本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 0%-95% 的股票资产，其余资产主要投资于权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具。因此，“中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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



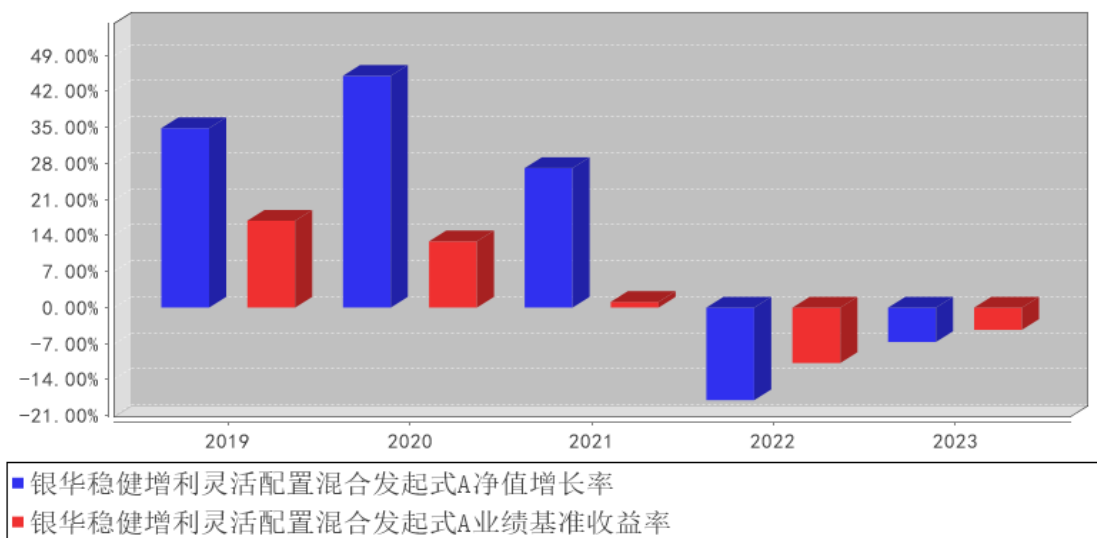
银华稳健增利灵活配置混合发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



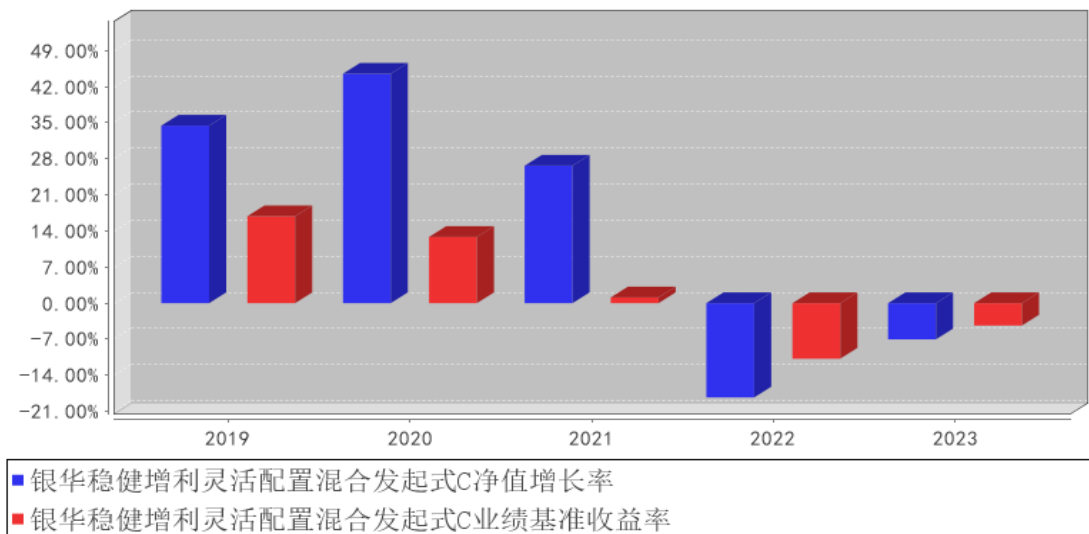
注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银华稳健增利灵活配置混合发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



银华稳健增利灵活配置混合发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人管理 197 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、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华尊享养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (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基金中基金、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基金中基金、银华鑫利一年持有期混合型基金中基金

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基金中基金（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、银华顺和债券型证券投资基金、银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华医疗健康混合型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华月月享 30 天持有期债券型证券投资基金、银华

上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华惠享三年定期开放混合型证券投资基金、银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金、银华致淳债券型证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马君女士	本基金的基金经理	2017 年 12 月 15 日	-	15.5 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

					<p>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，自 2023 年 9 月 6 日起兼任银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 3 日起兼任银华国证港股通创新药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>
张凯先生	本基金的基金经理	2021 年 9 月 28 日	-	14.5 年	<p>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</p>

				<p>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 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 日至 2023 年 9 月 8 日兼任银华中证港股通医药卫生综</p>
--	--	--	--	--

					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，自 2023 年 8 月 23 日起兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 12 月 1 日起兼任银华中证 2000 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。
杨腾先生	本基金的基金经理	2021 年 11 月 29 日	-	11.5 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。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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四个季度不同时间窗内（1日内、3日内及5日内）同向交易的交易价差从T检验（置信度为95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有12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

2023年中，宏观经济从疫情中走出，从年初以来，整体呈现从脉冲反弹到脉冲回落，最终缓慢复苏的运行特点。分经济部门来看，居民出行、居民消费等领域处于持续的复苏通道中，这在各个节假日的数据中体现明显；同时，商务活动尤其是与地产链条相关的商务活动，复苏进程仍然较弱，这在消费价位段、投融资结构等数据上有所显现。从海外来看，美联储在全年内以加息为主，使得外汇和国际资本流动都面临新的环境特点。这些外部因素在年末也正在迎来边际上的变化。在上述因素的作用下，A股市场主要指数在2023年有所下跌，行业之间则呈现涨跌互现：通信、传媒、煤炭等行业表现领先，而消费者服务、房地产、电力设备及新能源等行业表现落后。

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 1.3664 元,本报告期基金份额净值增长率为-6.69%;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 1.3405 元,本报告期基金份额净值增长率为-7.02%;业绩比较基准收益率为-4.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年我们认为,经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生,我们正处于这样的进程中。随着这个进程的深入,经济活动的扩张、收入水平的提升,都将是一个缓慢但持续的过程;而随着新旧更替的深入,经济也将会逐渐出现一些新的特点。未来一段时期,国内政策、汇率水平、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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期,基金管理人始终坚持持有人利益优先原则,持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化,根据法律法规、监管规定和业务发展的需要,持续健全合规管理及监察稽核机制,改进合规管理方式,提高合规管理能力,推进合规文化建设,提升合规管理工作的有效性。

本报告期,本基金管理人始终以法律法规、基金合同和公司制度为基础,持续健全合规制度,完善合规管理体系,提升专业能力,通过合规审核、合规检查、合规咨询等管理和防范潜在合规风险,保障各项业务规范开展。本基金管理人贯彻落实“风险为本”反洗钱理念,健全反洗钱制度建设、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用,持续完善反洗钱合规和风险管理长效机制。本基金管理人综合运用合规培训、合规宣导、合规承诺、合规提示、合规谈话等多种举措厚植合规经营文化,强化人员合规意识,夯实合规文化体系基础。

本报告期内,本基金管理人根据监管规则、公司业务发展情况,建立合规风险库机制并动态更新,要求业务部门定期对照自查,加强一道防线作用,夯实合规主体责任,尽早发现和和业务中存在的合规问题和风险隐患;同时,根据年初制定监察稽核工作计划及实际情况,以日常检查、专项检查或抽查的形式开展了对投资、研究、交易、营销、宣传推介、投资者适当性、员工行为、反洗钱业务等业务环节的合规检查工作,督促责任部门落实整改,促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金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 7 月 26 日、2023 年 8 月 3 日至 2023 年 12 月 31 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遵规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70026197_A54 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进</p>

	行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对银华稳健增利灵活配置混合型基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华稳健增利灵活配置混合型基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蒋燕华 朱 燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2024年3月27日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,139,490.04	4,667,897.36
结算备付金		115,523.78	264,112.06
存出保证金		2,148.02	1,817.31
交易性金融资产	7.4.7.2	24,015,734.32	49,574,251.33
其中：股票投资		24,015,734.32	49,574,251.33
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,006,199.79	1,493.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		37,279,095.95	54,509,571.28
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		59.29	-
应付赎回款		6,244.40	30,185.73
应付管理人报酬		13,753.34	22,886.92
应付托管费		3,438.33	5,721.73
应付销售服务费		702.10	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	7.4.7.9	68,283.60	80,069.65
负债合计		92,481.06	142,592.06
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	27,392,522.69	37,355,856.04
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	9,794,092.20	17,011,123.18
净资产合计		37,186,614.89	54,366,979.22
负债和净资产总计		37,279,095.95	54,509,571.28

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 27,392,522.69 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 17,993,920.11 份，基金份额净值 1.3664 元。银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额总额 9,398,602.58 份，基金份额净值 1.3405 元。

7.2 利润表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,250,994.58	-7,067,484.45
1. 利息收入		12,906.23	12,965.39
其中：存款利息收入	7.4.7.13	12,906.23	12,965.39
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,731,842.04	-5,233,360.37
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-3,224,426.54	-5,702,081.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	3,185.89	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	489,398.61	468,720.81
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）	7.4.7.20	1,213,108.60	-1,851,782.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	254,832.63	4,693.27
减：二、营业总支出		290,820.13	306,544.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	187,194.87	199,931.64
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	46,798.83	49,982.96
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	9,689.67	10,381.98
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	47,136.76	46,248.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,541,814.71	-7,374,029.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,541,814.71	-7,374,029.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,541,814.71	-7,374,029.03

7.3 净资产变动表

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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	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	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)	-9,963,333.35	-	-7,217,030.98	-17,180,364.33
(一)、综合收益总额	-	-	-1,541,814.71	-1,541,814.71
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-9,963,333.35	-	-5,675,216.27	-15,638,549.62
其中：1. 基金申购款	26,216,462.40	-	11,434,688.49	37,651,150.89
2. 基金赎回款	-36,179,795.75	-	-17,109,904.76	-53,289,700.51
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,392,522.69	-	9,794,092.20	37,186,614.89
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31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	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	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)	17,228,167.13	-	1,233,097.50	18,461,264.63
(一)、综合收益总额	-	-	-7,374,029.03	-7,374,029.03

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	17,228,167.13	-	8,607,126.53	25,835,293.66
其中：1. 基金申购款	19,294,239.54	-	9,751,950.00	29,046,189.54
2. 基金赎回款	-2,066,072.41	-	-1,144,823.47	-3,210,895.88
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	37,355,856.04	-	17,011,123.18	54,366,979.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违

约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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

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

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评

估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现

利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

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

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交

易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票

收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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

7.4.6.3 企业所得税

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

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

7.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	2,139,490.04	4,667,897.36
等于：本金	2,139,298.69	4,667,361.23
加：应计利息	191.35	536.13

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	2,139,490.04	4,667,897.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	24,231,567.40	-	24,015,734.32	-215,833.08
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	24,231,567.40	-	24,015,734.32	-215,833.08
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,003,193.01	-	49,574,251.33	-1,428,941.68
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	51,003,193.01	-	49,574,251.33	-1,428,941.68

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	33.65
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	23,283.60	35,036.00
其中：交易所市场	23,283.60	35,036.00
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	45,000.00	45,000.00
合计	68,283.60	80,069.65

7.4.7.10 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 12 月 31 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	1,244,298.84	1,244,298.84
本期赎回（以“-”号填列）	-5,899,016.17	-5,899,016.17
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	17,993,920.11	17,993,920.11

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 12 月 31 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	24,972,163.56	24,972,163.56
本期赎回（以“-”号填列）	-30,280,779.58	-30,280,779.58
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	9,398,602.58	9,398,602.58

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

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	16,384,903.98	-5,870,218.99	10,514,684.99
本期利润	-2,381,521.65	673,238.69	-1,708,282.96
本期基金份额交易产生的变动数	-3,238,205.85	1,025,574.14	-2,212,631.71
其中：基金申购款	944,859.75	-282,911.67	661,948.08
基金赎回款	-4,183,065.60	1,308,485.81	-2,874,579.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,765,176.48	-4,171,406.16	6,593,770.32

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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,260,190.08	-3,763,751.89	6,496,438.19
本期利润	-373,401.66	539,869.91	166,468.25
本期基金份额交易产生的变动数	-4,534,509.55	1,071,924.99	-3,462,584.56
其中：基金申购款	16,563,846.81	-5,791,106.40	10,772,740.41
基金赎回款	-21,098,356.36	6,863,031.39	-14,235,324.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,352,278.87	-2,151,956.99	3,200,321.88

7.4.7.13 存款利息收入

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	10,199.19	10,191.37
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	2,585.25	2,693.97
其他	121.79	80.05

合计	12,906.23	12,965.39
----	-----------	-----------

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,224,426.54	-5,702,081.18
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	-3,224,426.54	-5,702,081.18

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	232,301,684.93	242,704,242.88
减：卖出股票成本总额	235,191,036.78	248,004,314.77
减：交易费用	335,074.69	402,009.29
买卖股票差价收入	-3,224,426.54	-5,702,081.18

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,543.89	-

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	642.00	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,185.89	-

7.4.7.15.2 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,340.00	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	199,358.00	-
减：应计利息总额	3,340.00	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	642.00	-

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	489,398.61	468,720.81
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	489,398.61	468,720.81

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	1,213,108.60	-1,851,782.74
股票投资	1,213,108.60	-1,851,782.74
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	1,213,108.60	-1,851,782.74

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	254,355.59	4,257.97
基金转换费收入	477.04	435.30
合计	254,832.63	4,693.27

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,136.76	1,248.00
合计	47,136.76	46,248.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人的股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人的股东
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东

珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
银华长安资产管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司

注：1、根据银华基金管理股份有限公司于 2023 年 9 月 27 日发布的公告，经中国证券监督管理委员会同意，银华基金管理股份有限公司已受让银华长安资产管理（北京）有限公司持有的深圳银华永泰创新投资有限公司全部股权，深圳银华永泰创新投资有限公司已变更为银华基金管理股份有限公司的全资子公司。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	187,194.87	199,931.64
其中：应支付销售机构的客户维护	16,038.33	19,234.66

费		
应支付基金管理人的净管理费	171,156.54	180,696.98

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

管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	46,798.83	49,982.96

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	823.53	823.53
中国工商银行	-	297.74	297.74
合计	-	1,121.27	1,121.27
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	合计
中国工商银行	-	363.83	363.83

银华基金管理股份有限公司	-	852.99	852.99
合计	-	1,216.82	1,216.82

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

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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 12 月 31 日	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	55.58%	-

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	44.16%	-

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,139,490.04	10,199.19	4,667,897.36	10,191.37

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大事项停牌	8.48	2024年1月10日	9.33	2,600	24,322.96	22,048.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不

超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人

定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,139,490.04	-	-	-	2,139,490.04
结算备付金	115,523.78	-	-	-	115,523.78
存出保证金	2,148.02	-	-	-	2,148.02
交易性金融资产	-	-	-	24,015,734.32	24,015,734.32
应收申购款	-	-	-	11,006,199.79	11,006,199.79
资产总计	2,257,161.84	-	-	35,021,934.11	37,279,095.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,244.40	6,244.40
应付管理人报酬	-	-	-	13,753.34	13,753.34
应付托管费	-	-	-	3,438.33	3,438.33
应付清算款	-	-	-	59.29	59.29
应付销售服务费	-	-	-	702.10	702.10
其他负债	-	-	-	68,283.60	68,283.60
负债总计	-	-	-	92,481.06	92,481.06
利率敏感度缺口	2,257,161.84	-	-	34,929,453.05	37,186,614.89
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					
货币资金	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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末（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。

7.4.13.4.2 外汇风险

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	24,015,734.32	64.58	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	-	-	-	-
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	24,015,734.32	64.58	49,574,251.33	91.18

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,975,870.92	3,075,327.03
	业绩比较基准下降 5%	-1,975,870.92	-3,075,327.03

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	23,993,686.32	49,574,251.33
第二层次	22,048.00	-
第三层次	-	-
合计	24,015,734.32	49,574,251.33

7.4.14.2.2 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、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

注：无。

7.4.15.2 其他事项

注：无。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,015,734.32	64.42
	其中：股票	24,015,734.32	64.42
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,255,013.82	6.05
8	其他各项资产	11,008,347.81	29.53
9	合计	37,279,095.95	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	174,997.00	0.47
B	采矿业	1,365,128.23	3.67
C	制造业	14,180,807.57	38.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	747,628.00	2.01
E	建筑业	550,416.13	1.48
F	批发和零售业	799,284.00	2.15
G	交通运输、仓储和邮政业	458,016.66	1.23
H	住宿和餐饮业	136,652.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,450,486.25	6.59
J	金融业	1,209,672.00	3.25
K	房地产业	454,055.00	1.22
L	租赁和商务服务业	165,700.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	275,934.48	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	27,863.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	44,064.00	0.12
Q	卫生和社会工作	386,440.00	1.04
R	文化、体育和娱乐业	475,308.00	1.28
S	综合	113,282.00	0.30
	合计	24,015,734.32	64.58

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600025	华能水电	22,100	190,723.00	0.51
2	002044	美年健康	31,500	189,315.00	0.51
3	601168	西部矿业	12,830	183,084.10	0.49

4	600519	贵州茅台	100	172,600.00	0.46
5	600028	中国石化	30,700	171,306.00	0.46
6	601857	中国石油	23,900	168,734.00	0.45
7	002600	领益智造	24,000	162,240.00	0.44
8	600066	宇通客车	12,200	161,650.00	0.43
9	600761	安徽合力	8,700	158,427.00	0.43
10	600535	天士力	9,300	158,286.00	0.43
11	002465	海格通信	11,500	147,775.00	0.40
12	600048	保利发展	14,900	147,510.00	0.40
13	000400	许继电气	6,600	144,936.00	0.39
14	000423	东阿阿胶	2,900	143,028.00	0.38
15	601898	中煤能源	14,300	138,567.00	0.37
16	600845	宝信软件	2,800	136,640.00	0.37
17	600998	九州通	19,400	135,994.00	0.37
18	002128	电投能源	9,300	132,711.00	0.36
19	600079	人福医药	5,300	131,758.00	0.35
20	300395	菲利华	3,600	131,616.00	0.35
21	002409	雅克科技	2,300	128,179.00	0.34
22	601567	三星医疗	6,172	126,526.00	0.34
23	002268	电科网安	5,500	123,530.00	0.33
24	002422	科伦药业	4,100	119,105.00	0.32
25	600258	首旅酒店	7,600	118,712.00	0.32
26	688055	龙腾光电	24,116	117,686.08	0.32
27	600161	天坛生物	3,800	117,572.00	0.32
28	601728	中国电信	21,700	117,397.00	0.32
29	600325	华发股份	16,000	115,360.00	0.31
30	600872	中炬高新	4,100	115,210.00	0.31
31	002572	索菲亚	7,100	113,245.00	0.30
32	002252	上海莱士	14,100	112,800.00	0.30
33	002152	广电运通	9,100	111,566.00	0.30
34	601328	交通银行	19,300	110,782.00	0.30
35	603712	七一二	3,500	110,285.00	0.30
36	300286	安科瑞	4,200	108,906.00	0.29
37	000568	泸州老窖	601	107,831.42	0.29
38	000009	中国宝安	8,900	104,486.00	0.28
39	688232	新点软件	2,859	103,495.80	0.28
40	601158	重庆水务	18,200	103,194.00	0.28
41	603997	继峰股份	7,500	101,025.00	0.27
42	601888	中国中免	1,200	100,428.00	0.27
43	600941	中国移动	1,000	99,480.00	0.27
44	600879	航天电子	12,900	99,459.00	0.27
45	600863	内蒙华电	25,500	99,450.00	0.27
46	000100	TCL 科技	22,300	95,890.00	0.26

47	600901	江苏金租	19,800	95,832.00	0.26
48	600582	天地科技	17,500	95,200.00	0.26
49	600566	济川药业	3,000	94,290.00	0.25
50	000039	中集集团	12,300	94,095.00	0.25
51	300454	深信服	1,300	93,977.00	0.25
52	601231	环旭电子	6,165	93,153.15	0.25
53	688625	呈和科技	2,355	92,363.10	0.25
54	300251	光线传媒	11,300	92,095.00	0.25
55	000960	锡业股份	6,400	91,648.00	0.25
56	688353	华盛锂电	3,297	90,337.80	0.24
57	601319	中国人保	18,600	90,024.00	0.24
58	300493	润欣科技	10,500	89,355.00	0.24
59	600160	巨化股份	5,407	89,161.43	0.24
60	600502	安徽建工	19,100	88,815.00	0.24
61	301177	迪阿股份	3,000	88,470.00	0.24
62	603730	岱美股份	6,100	88,389.00	0.24
63	600588	用友网络	4,800	85,392.00	0.23
64	002153	石基信息	8,720	84,932.80	0.23
65	600642	申能股份	13,200	84,744.00	0.23
66	301122	采纳股份	2,500	84,650.00	0.23
67	601318	中国平安	2,100	84,630.00	0.23
68	002028	思源电气	1,600	83,264.00	0.22
69	601928	凤凰传媒	9,300	81,933.00	0.22
70	601000	唐山港	22,800	79,800.00	0.21
71	688265	南模生物	2,066	79,437.70	0.21
72	688105	诺唯赞	2,479	79,377.58	0.21
73	688107	安路科技	2,156	79,297.68	0.21
74	601138	工业富联	5,200	78,624.00	0.21
75	600893	航发动力	2,100	78,498.00	0.21
76	600188	兖矿能源	3,900	77,259.00	0.21
77	600967	内蒙一机	8,975	74,133.50	0.20
78	301308	江波龙	800	73,640.00	0.20
79	002065	东华软件	11,900	73,423.00	0.20
80	603556	海兴电力	2,500	72,575.00	0.20
81	688728	格科微	3,521	72,074.87	0.19
82	300285	国瓷材料	3,100	71,672.00	0.19
83	601100	恒立液压	1,300	71,084.00	0.19
84	300456	赛微电子	2,900	69,716.00	0.19
85	603298	杭叉集团	2,800	69,664.00	0.19
86	600019	宝钢股份	11,700	69,381.00	0.19
87	601169	北京银行	15,300	69,309.00	0.19
88	002444	巨星科技	3,070	69,136.40	0.19
89	000932	华菱钢铁	13,400	69,010.00	0.19

90	600153	建发股份	7,100	68,373.00	0.18
91	601019	山东出版	7,200	67,536.00	0.18
92	000547	航天发展	8,000	66,960.00	0.18
93	001330	博纳影业	9,100	65,520.00	0.18
94	601186	中国铁建	8,600	65,446.00	0.18
95	688772	珠海冠宇	2,962	65,193.62	0.18
96	002475	立讯精密	1,878	64,697.10	0.17
97	000858	五粮液	461	64,682.91	0.17
98	600699	均胜电子	3,600	64,656.00	0.17
99	300666	江丰电子	1,100	64,438.00	0.17
100	601600	中国铝业	11,400	64,296.00	0.17
101	000778	新兴铸管	16,800	64,176.00	0.17
102	601668	中国建筑	13,331	64,122.11	0.17
103	600637	东方明珠	8,500	63,920.00	0.17
104	600141	兴发集团	3,500	63,875.00	0.17
105	002273	水晶光电	4,700	63,638.00	0.17
106	000998	隆平高科	4,500	63,450.00	0.17
107	601989	中国重工	15,300	63,189.00	0.17
108	600938	中国海油	3,000	62,910.00	0.17
109	601598	中国外运	11,900	62,356.00	0.17
110	002223	鱼跃医疗	1,800	62,244.00	0.17
111	600755	厦门国贸	8,800	61,336.00	0.16
112	601233	桐昆股份	4,000	60,520.00	0.16
113	300529	健帆生物	2,700	60,021.00	0.16
114	300586	美联新材	7,400	59,866.00	0.16
115	000598	兴蓉环境	10,500	59,745.00	0.16
116	002129	TCL 中环	3,801	59,447.64	0.16
117	600085	同仁堂	1,100	59,070.00	0.16
118	603826	坤彩科技	1,000	59,030.00	0.16
119	002532	天山铝业	9,800	58,898.00	0.16
120	601658	邮储银行	13,500	58,725.00	0.16
121	603711	香飘飘	3,400	58,276.00	0.16
122	002244	滨江集团	8,000	58,160.00	0.16
123	000725	京东方 A	14,900	58,110.00	0.16
124	002558	巨人网络	5,200	57,928.00	0.16
125	601618	中国中冶	18,700	57,222.00	0.15
126	603225	新凤鸣	4,000	56,800.00	0.15
127	600060	海信视像	2,714	56,722.60	0.15
128	601088	中国神华	1,800	56,430.00	0.15
129	000783	长江证券	10,400	55,952.00	0.15
130	600392	盛和资源	5,401	54,982.18	0.15
131	603379	三美股份	1,600	54,400.00	0.15
132	600511	国药股份	1,900	54,378.00	0.15

133	601198	东兴证券	6,600	54,318.00	0.15
134	000963	华东医药	1,300	53,898.00	0.14
135	002373	千方科技	4,800	53,808.00	0.14
136	603866	桃李面包	7,000	53,620.00	0.14
137	600219	南山铝业	18,200	53,508.00	0.14
138	601390	中国中铁	9,400	53,392.00	0.14
139	002673	西部证券	8,300	52,871.00	0.14
140	002063	远光软件	8,540	52,777.20	0.14
141	688699	明微电子	1,307	52,737.45	0.14
142	600497	驰宏锌锗	10,200	51,510.00	0.14
143	002439	启明星辰	1,900	51,300.00	0.14
144	300045	华力创通	2,100	51,093.00	0.14
145	000975	银泰黄金	3,400	51,000.00	0.14
145	002567	唐人神	6,800	51,000.00	0.14
146	000156	华数传媒	6,900	50,853.00	0.14
147	002372	伟星新材	3,500	50,645.00	0.14
148	600580	卧龙电驱	4,300	50,439.00	0.14
149	300017	网宿科技	6,400	50,240.00	0.14
150	603889	新澳股份	7,000	49,840.00	0.13
151	600885	宏发股份	1,800	49,752.00	0.13
152	300132	青松股份	9,500	49,590.00	0.13
153	000728	国元证券	7,200	49,176.00	0.13
154	002741	光华科技	3,300	49,071.00	0.13
155	600690	海尔智家	2,322	48,762.00	0.13
156	601991	大唐发电	20,100	48,642.00	0.13
157	600702	舍得酒业	500	48,350.00	0.13
158	601933	永辉超市	17,000	47,940.00	0.13
159	600285	羚锐制药	2,800	47,908.00	0.13
160	003035	南网能源	9,100	47,866.00	0.13
161	300738	奥飞数据	4,500	47,655.00	0.13
162	002645	华宏科技	4,201	47,471.30	0.13
163	002956	西麦食品	3,300	47,289.00	0.13
164	601801	皖新传媒	6,800	47,260.00	0.13
165	002436	兴森科技	3,200	47,136.00	0.13
166	600779	水井坊	800	47,016.00	0.13
167	601939	建设银行	7,200	46,872.00	0.13
168	000596	古井贡酒	200	46,560.00	0.13
169	600266	城建发展	9,600	46,464.00	0.12
170	300191	潜能恒信	3,000	46,410.00	0.12
171	600737	中粮糖业	5,600	46,144.00	0.12
172	000503	国新健康	3,500	46,130.00	0.12
173	300015	爱尔眼科	2,900	45,878.00	0.12
174	601566	九牧王	4,600	45,862.00	0.12

175	300257	开山股份	2,900	45,704.00	0.12
176	603816	顾家家居	1,300	45,500.00	0.12
177	002219	新里程	15,000	45,450.00	0.12
178	600674	川投能源	3,000	45,360.00	0.12
179	000650	仁和药业	6,700	44,421.00	0.12
180	600350	山东高速	6,400	44,416.00	0.12
181	300124	汇川技术	700	44,198.00	0.12
182	002607	中公教育	10,800	44,064.00	0.12
183	600177	雅戈尔	6,600	43,230.00	0.12
184	002790	瑞尔特	4,100	42,804.00	0.12
185	000528	柳 工	6,300	42,462.00	0.11
186	002294	信立泰	1,300	42,458.00	0.11
187	002032	苏 泊 尔	800	42,408.00	0.11
188	603039	泛微网络	900	42,210.00	0.11
189	300498	温氏股份	2,100	42,126.00	0.11
190	600029	南方航空	7,300	42,048.00	0.11
191	688331	荣昌生物	677	42,014.62	0.11
192	601108	财通证券	5,400	41,904.00	0.11
193	600750	江中药业	2,000	41,760.00	0.11
194	000050	深天马 A	3,900	41,535.00	0.11
195	000776	广发证券	2,900	41,441.00	0.11
196	000997	新 大 陆	2,100	41,181.00	0.11
197	000338	潍柴动力	3,000	40,950.00	0.11
198	002138	顺络电子	1,500	40,515.00	0.11
199	688099	晶晨股份	643	40,271.09	0.11
200	600570	恒生电子	1,400	40,264.00	0.11
201	600663	陆家嘴	4,600	40,250.00	0.11
202	002946	新乳业	3,400	39,032.00	0.10
203	603085	天成自控	3,800	38,760.00	0.10
204	002390	信邦制药	8,700	38,628.00	0.10
205	002212	天融信	3,900	38,142.00	0.10
206	603893	瑞芯微	600	38,040.00	0.10
207	002605	姚记科技	1,700	37,774.00	0.10
208	600299	安迪苏	4,700	37,600.00	0.10
209	002966	苏州银行	5,800	37,468.00	0.10
210	600933	爱柯迪	1,700	37,298.00	0.10
211	600801	华新水泥	3,000	37,290.00	0.10
212	002019	亿帆医药	2,500	36,950.00	0.10
213	601689	拓普集团	500	36,750.00	0.10
214	000799	酒鬼酒	500	36,575.00	0.10
215	000810	创维数字	2,300	36,133.00	0.10
216	000951	中国重汽	2,701	36,085.36	0.10
217	300348	长亮科技	3,500	36,085.00	0.10

218	688100	威胜信息	1,243	35,947.56	0.10
219	688262	国芯科技	1,225	35,941.50	0.10
220	002438	江苏神通	3,000	35,850.00	0.10
221	600339	中油工程	11,800	35,754.00	0.10
222	002091	江苏国泰	4,500	35,235.00	0.09
223	600664	哈药股份	10,500	35,175.00	0.09
224	300893	松原股份	1,200	35,076.00	0.09
225	688252	天德钰	1,754	35,009.84	0.09
226	688598	金博股份	500	34,950.00	0.09
227	603688	石英股份	400	34,752.00	0.09
228	301239	普瑞眼科	400	34,400.00	0.09
229	003000	劲仔食品	2,800	34,216.00	0.09
230	601058	赛轮轮胎	2,874	33,769.50	0.09
231	601225	陕西煤业	1,600	33,424.00	0.09
232	002840	华统股份	1,600	33,264.00	0.09
233	002876	三利谱	900	33,093.00	0.09
234	300136	信维通信	1,400	33,040.00	0.09
235	002649	博彦科技	2,600	31,902.00	0.09
236	002318	久立特材	1,600	31,808.00	0.09
237	000063	中兴通讯	1,200	31,776.00	0.09
238	600312	平高电气	2,500	31,725.00	0.09
239	688559	海目星	881	31,451.70	0.08
240	002334	英威腾	3,600	31,428.00	0.08
241	002557	洽洽食品	900	31,338.00	0.08
242	600422	昆药集团	1,500	31,290.00	0.08
243	002472	双环传动	1,200	31,224.00	0.08
244	603668	天马科技	1,700	31,178.00	0.08
245	603848	好太太	2,000	30,960.00	0.08
246	688551	科威尔	537	30,662.70	0.08
247	688676	金盘科技	853	30,562.99	0.08
248	601229	上海银行	5,100	30,447.00	0.08
249	300677	英科医疗	1,300	30,368.00	0.08
250	600372	中航机载	2,300	30,314.00	0.08
251	300363	博腾股份	1,200	30,180.00	0.08
252	601717	郑煤机	2,371	29,993.15	0.08
253	600489	中金黄金	3,000	29,880.00	0.08
254	300181	佐力药业	2,800	29,848.00	0.08
255	600546	山煤国际	1,700	29,767.00	0.08
256	300101	振芯科技	1,300	29,679.00	0.08
257	601006	大秦铁路	4,100	29,561.00	0.08
258	688111	金山办公	93	29,406.60	0.08
259	300750	宁德时代	180	29,386.80	0.08
260	600909	华安证券	6,000	29,280.00	0.08

261	600867	通化东宝	2,700	29,241.00	0.08
262	002078	太阳纸业	2,400	29,208.00	0.08
263	000661	长春高新	200	29,160.00	0.08
264	300760	迈瑞医疗	100	29,060.00	0.08
265	601298	青岛港	4,700	29,046.00	0.08
266	600131	国网信通	1,900	28,785.00	0.08
267	000552	甘肃能化	9,401	28,673.05	0.08
268	002281	光迅科技	1,000	28,500.00	0.08
269	601211	国泰君安	1,900	28,272.00	0.08
270	600820	隧道股份	4,900	28,224.00	0.08
271	300782	卓胜微	200	28,200.00	0.08
272	601156	东航物流	1,900	28,082.00	0.08
273	603939	益丰药房	700	28,028.00	0.08
274	300627	华测导航	900	27,918.00	0.08
275	300682	朗新集团	1,700	27,863.00	0.07
276	000089	深圳机场	4,312	27,726.16	0.07
277	300296	利亚德	4,600	27,600.00	0.07
278	601998	中信银行	5,200	27,508.00	0.07
279	002675	东诚药业	1,500	27,495.00	0.07
280	002180	纳思达	1,200	27,156.00	0.07
281	000555	神州信息	2,400	27,096.00	0.07
282	002203	海亮股份	2,410	26,871.50	0.07
283	002327	富安娜	3,000	26,850.00	0.07
284	002745	木林森	3,100	26,846.00	0.07
285	603198	迎驾贡酒	400	26,516.00	0.07
286	600158	中体产业	3,400	26,452.00	0.07
287	002697	红旗连锁	5,300	26,394.00	0.07
288	300979	华利集团	500	26,320.00	0.07
289	600487	亨通光电	2,200	26,268.00	0.07
290	002092	中泰化学	4,300	26,230.00	0.07
291	002705	新宝股份	1,800	26,226.00	0.07
292	300244	迪安诊断	1,100	26,191.00	0.07
293	300759	康龙化成	900	26,082.00	0.07
294	603232	格尔软件	1,900	26,011.00	0.07
295	000516	国际医学	3,200	25,952.00	0.07
296	002196	方正电机	3,600	25,848.00	0.07
297	603308	应流股份	1,800	25,794.00	0.07
298	003006	百亚股份	1,700	25,772.00	0.07
299	002131	利欧股份	11,300	25,764.00	0.07
300	000709	河钢股份	12,094	25,760.22	0.07
301	688238	和元生物	2,860	25,711.40	0.07
302	002130	沃尔核材	3,400	25,670.00	0.07
303	688616	西力科技	1,870	25,506.80	0.07

304	300986	志特新材	2,000	25,460.00	0.07
305	300806	斯迪克	1,800	25,326.00	0.07
306	002241	歌尔股份	1,200	25,212.00	0.07
307	300849	锦盛新材	1,900	25,156.00	0.07
308	300543	朗科智能	2,300	25,116.00	0.07
308	603659	璞泰来	1,200	25,116.00	0.07
309	600989	宝丰能源	1,700	25,109.00	0.07
310	300041	回天新材	2,500	25,050.00	0.07
311	600886	国投电力	1,900	25,042.00	0.07
312	002534	西子洁能	2,000	24,980.00	0.07
313	300679	电连技术	600	24,900.00	0.07
313	603839	安正时尚	3,000	24,900.00	0.07
314	000157	中联重科	3,800	24,814.00	0.07
315	002498	汉缆股份	6,200	24,800.00	0.07
316	000887	中鼎股份	2,000	24,740.00	0.07
317	600015	华夏银行	4,400	24,728.00	0.07
318	688520	神州细胞	459	24,726.33	0.07
319	688153	唯捷创芯	376	24,628.00	0.07
320	605589	圣泉集团	1,100	24,618.00	0.07
321	002743	富煌钢构	4,100	24,518.00	0.07
322	688300	联瑞新材	463	24,515.85	0.07
323	600271	航天信息	2,300	24,472.00	0.07
324	000655	金岭矿业	3,400	24,378.00	0.07
325	600862	中航高科	1,100	24,365.00	0.07
326	002068	黑猫股份	2,100	24,360.00	0.07
327	300298	三诺生物	800	24,320.00	0.07
328	002402	和而泰	1,700	24,293.00	0.07
329	300054	鼎龙股份	1,000	24,200.00	0.07
330	688127	蓝特光学	1,037	24,151.73	0.06
331	300183	东软载波	1,600	24,144.00	0.06
332	000685	中山公用	3,300	24,123.00	0.06
333	601126	四方股份	1,700	24,072.00	0.06
334	000698	沈阳化工	5,700	24,054.00	0.06
335	002775	文科股份	6,000	24,000.00	0.06
336	300719	安达维尔	1,800	23,994.00	0.06
337	002215	诺普信	2,900	23,954.00	0.06
338	600598	北大荒	2,000	23,940.00	0.06
339	002940	昂利康	1,100	23,881.00	0.06
340	605388	均瑶健康	1,900	23,826.00	0.06
341	603920	世运电路	1,300	23,764.00	0.06
342	688126	沪硅产业	1,372	23,763.04	0.06
343	688489	三未信安	504	23,698.08	0.06
344	002221	东华能源	2,300	23,690.00	0.06

345	603989	艾华集团	1,100	23,672.00	0.06
346	600987	航民股份	2,700	23,652.00	0.06
347	300768	迪普科技	1,600	23,648.00	0.06
348	600216	浙江医药	2,200	23,606.00	0.06
349	601366	利群股份	4,300	23,478.00	0.06
350	002925	盈趣科技	1,200	23,364.00	0.06
351	300639	凯普生物	2,500	23,350.00	0.06
352	600063	皖维高新	5,400	23,220.00	0.06
353	300653	正海生物	800	23,216.00	0.06
354	605303	园林股份	1,900	23,180.00	0.06
355	688008	澜起科技	394	23,151.44	0.06
356	600038	中直股份	600	23,118.00	0.06
357	000166	申万宏源	5,200	23,088.00	0.06
358	600809	山西汾酒	100	23,073.00	0.06
359	688335	复洁环保	1,792	22,991.36	0.06
360	301327	华宝新能	300	22,920.00	0.06
361	300820	英杰电气	400	22,912.00	0.06
362	300996	普联软件	1,000	22,900.00	0.06
363	300382	斯莱克	2,300	22,839.00	0.06
364	603885	吉祥航空	1,900	22,800.00	0.06
365	600276	恒瑞医药	500	22,615.00	0.06
366	603901	永创智能	1,900	22,610.00	0.06
367	600585	海螺水泥	1,000	22,560.00	0.06
368	600195	中牧股份	1,900	22,534.00	0.06
369	603707	健友股份	1,500	22,500.00	0.06
370	300009	安科生物	2,200	22,484.00	0.06
371	301017	漱玉平民	1,100	22,473.00	0.06
372	600764	中国海防	900	22,455.00	0.06
373	600660	福耀玻璃	600	22,434.00	0.06
374	600971	恒源煤电	2,000	22,300.00	0.06
375	688680	海优新材	339	22,255.35	0.06
376	688568	中科星图	453	22,224.18	0.06
377	603708	家家悦	1,700	22,219.00	0.06
378	000553	安道麦 A	3,200	22,208.00	0.06
379	300476	胜宏科技	1,200	22,140.00	0.06
380	000761	本钢板材	6,200	22,134.00	0.06
381	000657	中钨高新	2,600	22,048.00	0.06
382	300299	富春股份	3,800	21,926.00	0.06
383	301033	迈普医学	500	21,770.00	0.06
384	688522	纳睿雷达	391	21,696.59	0.06
385	003001	中岩大地	1,200	21,684.00	0.06
386	300088	长信科技	3,217	21,521.73	0.06
387	301015	百洋医药	600	21,516.00	0.06

388	600887	伊利股份	800	21,400.00	0.06
389	002916	深南电路	300	21,297.00	0.06
390	600298	安琪酵母	600	21,108.00	0.06
391	688175	高凌信息	754	21,059.22	0.06
392	603313	梦百合	2,000	21,000.00	0.06
393	600480	凌云股份	2,300	20,953.00	0.06
394	002739	万达电影	1,600	20,832.00	0.06
395	601611	中国核建	3,000	20,790.00	0.06
396	688246	嘉和美康	619	20,686.98	0.06
397	300628	亿联网络	700	20,685.00	0.06
398	002714	牧原股份	500	20,590.00	0.06
399	688225	亚信安全	1,122	20,577.48	0.06
400	002035	华帝股份	3,300	20,493.00	0.06
401	300450	先导智能	800	20,480.00	0.06
402	600985	淮北矿业	1,216	20,222.08	0.05
403	002419	天虹股份	3,600	19,908.00	0.05
404	000999	华润三九	400	19,892.00	0.05
405	603305	旭升集团	1,000	19,730.00	0.05
406	603919	金徽酒	800	19,696.00	0.05
407	600446	金证股份	1,700	19,669.00	0.05
408	300578	会畅通讯	1,100	19,646.00	0.05
409	002027	分众传媒	3,100	19,592.00	0.05
410	600428	中远海特	3,600	19,296.00	0.05
411	301267	华夏眼科	600	19,254.00	0.05
412	688139	海尔生物	475	19,247.00	0.05
413	301051	信濠光电	300	19,101.00	0.05
414	300026	红日药业	4,500	19,080.00	0.05
415	600416	湘电股份	1,200	19,056.00	0.05
416	300638	广和通	1,000	19,030.00	0.05
417	601601	中国太保	800	19,024.00	0.05
418	688768	容知日新	516	18,993.96	0.05
419	300037	新宙邦	400	18,920.00	0.05
420	000402	金融街	5,200	18,876.00	0.05
421	603035	常熟汽饰	1,000	18,870.00	0.05
422	600739	辽宁成大	1,600	18,848.00	0.05
423	605060	联德股份	1,000	18,700.00	0.05
424	300699	光威复材	700	18,669.00	0.05
425	603170	宝立食品	1,100	18,601.00	0.05
426	600399	抚顺特钢	1,900	18,468.00	0.05
427	688425	铁建重工	4,645	18,440.65	0.05
428	603136	天目湖	1,000	18,370.00	0.05
429	300575	中旗股份	2,400	18,336.00	0.05
430	600201	生物股份	1,700	18,309.00	0.05

431	002841	视源股份	400	18,304.00	0.05
432	000048	京基智农	1,000	18,300.00	0.05
433	688663	新风光	652	18,282.08	0.05
434	300803	指南针	300	18,078.00	0.05
435	300161	华中数控	500	17,950.00	0.05
436	600754	锦江酒店	600	17,940.00	0.05
437	300866	安克创新	200	17,720.00	0.05
438	600011	华能国际	2,300	17,710.00	0.05
439	300451	创业慧康	2,700	17,685.00	0.05
440	601633	长城汽车	700	17,654.00	0.05
441	300773	拉卡拉	1,100	17,644.00	0.05
442	600746	江苏索普	2,400	17,568.00	0.05
443	601288	农业银行	4,800	17,472.00	0.05
444	002415	海康威视	500	17,360.00	0.05
445	300592	华凯易佰	700	17,339.00	0.05
446	688786	悦安新材	390	17,331.60	0.05
447	002081	金螳螂	4,600	17,296.00	0.05
448	688208	道通科技	727	17,266.25	0.05
449	000930	中粮科技	2,600	17,264.00	0.05
450	600765	中航重机	900	17,199.00	0.05
451	000415	渤海租赁	8,000	17,120.00	0.05
452	603518	锦泓集团	1,700	17,034.00	0.05
453	688521	芯原股份	339	16,936.44	0.05
454	002555	三七互娱	900	16,929.00	0.05
455	300385	雪浪环境	2,500	16,800.00	0.05
456	600199	金种子酒	900	16,668.00	0.04
457	603100	川仪股份	600	16,632.00	0.04
458	600562	国睿科技	1,200	16,608.00	0.04
459	603151	邦基科技	1,100	16,599.00	0.04
460	301338	凯格精机	400	16,400.00	0.04
461	002434	万里扬	2,200	16,390.00	0.04
462	000333	美的集团	300	16,389.00	0.04
463	300319	麦捷科技	1,700	16,388.00	0.04
464	002036	联创电子	1,600	16,336.00	0.04
465	688003	天准科技	433	16,246.16	0.04
466	300510	金冠股份	2,700	16,119.00	0.04
467	603758	秦安股份	1,400	16,016.00	0.04
468	001872	招商港口	1,000	15,960.00	0.04
469	688596	正帆科技	401	15,891.63	0.04
470	603678	火炬电子	600	15,882.00	0.04
471	300253	卫宁健康	2,200	15,818.00	0.04
472	300832	新产业	200	15,640.00	0.04
473	002517	恺英网络	1,400	15,638.00	0.04

474	002124	天邦食品	4,300	15,609.00	0.04
475	300709	精研科技	500	15,595.00	0.04
476	603279	景津装备	700	15,477.00	0.04
477	000630	铜陵有色	4,700	15,416.00	0.04
478	002271	东方雨虹	800	15,360.00	0.04
479	688185	康希诺	200	14,904.00	0.04
480	000538	云南白药	300	14,745.00	0.04
481	000425	徐工机械	2,700	14,742.00	0.04
482	603300	华铁应急	2,300	14,720.00	0.04
483	688031	星环科技	226	14,705.82	0.04
484	002414	高德红外	2,000	14,600.00	0.04
485	000021	深科技	900	14,589.00	0.04
486	688006	杭可科技	621	14,581.08	0.04
487	603558	健盛集团	1,500	14,535.00	0.04
488	688388	嘉元科技	714	14,479.92	0.04
489	000883	湖北能源	3,400	14,382.00	0.04
490	600873	梅花生物	1,500	14,325.00	0.04
491	601179	中国西电	2,900	14,297.00	0.04
492	002991	甘源食品	200	14,292.00	0.04
493	603871	嘉友国际	900	14,274.00	0.04
494	603815	交建股份	1,700	14,212.00	0.04
495	002340	格林美	2,600	14,196.00	0.04
496	688322	奥比中光	375	14,092.50	0.04
497	688095	福昕软件	200	13,970.00	0.04
498	600059	古越龙山	1,500	13,950.00	0.04
499	600016	民生银行	3,700	13,838.00	0.04
500	601636	旗滨集团	2,000	13,680.00	0.04
501	600348	华阳股份	1,400	13,664.00	0.04
502	688009	中国通号	3,099	13,573.62	0.04
503	603936	博敏电子	1,300	13,572.00	0.04
504	003019	宸展光电	600	13,560.00	0.04
505	600821	金开新能	2,200	13,464.00	0.04
506	002602	世纪华通	2,600	13,416.00	0.04
507	002158	汉钟精机	600	13,356.00	0.04
507	601117	中国化学	2,100	13,356.00	0.04
508	600037	歌华有线	1,700	13,141.00	0.04
509	300566	激智科技	700	13,076.00	0.04
510	600848	上海临港	1,300	13,065.00	0.04
511	002920	德赛西威	100	12,951.00	0.03
512	300003	乐普医疗	800	12,928.00	0.03
513	601128	常熟银行	2,000	12,780.00	0.03
514	601990	南京证券	1,600	12,768.00	0.03
515	603737	三棵树	268	12,759.48	0.03

516	000723	美锦能源	1,900	12,654.00	0.03
517	603983	丸美股份	500	12,635.00	0.03
518	601615	明阳智能	1,000	12,540.00	0.03
519	300065	海兰信	1,200	12,204.00	0.03
520	300767	震安科技	700	12,166.00	0.03
521	002945	华林证券	800	12,080.00	0.03
522	603927	中科软	400	11,992.00	0.03
523	000738	航发控制	600	11,940.00	0.03
524	300433	蓝思科技	900	11,880.00	0.03
525	600352	浙江龙盛	1,400	11,760.00	0.03
526	300383	光环新网	1,200	11,664.00	0.03
527	002653	海思科	500	11,575.00	0.03
528	002815	崇达技术	1,200	11,496.00	0.03
529	300073	当升科技	300	11,460.00	0.03
530	301391	卡莱特	100	11,448.00	0.03
531	300308	中际旭创	101	11,403.91	0.03
532	600496	精工钢构	3,700	11,285.00	0.03
533	601098	中南传媒	1,100	11,187.00	0.03
534	002938	鹏鼎控股	500	11,160.00	0.03
534	600406	国电南瑞	500	11,160.00	0.03
535	002185	华天科技	1,300	11,076.00	0.03
536	600481	双良节能	1,300	10,998.00	0.03
537	688065	凯赛生物	200	10,996.00	0.03
538	002249	大洋电机	2,200	10,934.00	0.03
539	600096	云天化	700	10,920.00	0.03
540	601222	林洋能源	1,700	10,863.00	0.03
541	000420	吉林化纤	3,700	10,767.00	0.03
542	601877	正泰电器	500	10,755.00	0.03
543	600556	天下秀	1,800	10,638.00	0.03
544	601908	京运通	2,300	10,511.00	0.03
545	000513	丽珠集团	300	10,503.00	0.03
546	688278	特宝生物	200	10,470.00	0.03
547	600528	中铁工业	1,400	10,416.00	0.03
548	601311	骆驼股份	1,300	10,413.00	0.03
549	002202	金风科技	1,300	10,400.00	0.03
550	300043	星辉娱乐	2,800	10,388.00	0.03
551	300558	贝达药业	200	10,310.00	0.03
552	600549	厦门钨业	600	10,308.00	0.03
553	600110	诺德股份	1,800	10,152.00	0.03
554	000933	神火股份	600	10,080.00	0.03
555	600237	铜峰电子	1,300	10,062.00	0.03
556	688517	金冠电气	637	10,058.23	0.03
557	600438	通威股份	400	10,012.00	0.03

558	601766	中国中车	1,900	9,994.00	0.03
559	600377	宁沪高速	974	9,983.50	0.03
560	002283	天润工业	1,700	9,945.00	0.03
561	688658	悦康药业	473	9,866.78	0.03
562	301283	聚胶股份	300	9,864.00	0.03
563	000878	云南铜业	900	9,801.00	0.03
564	601399	国机重装	3,400	9,622.00	0.03
565	600510	黑牡丹	1,700	9,605.00	0.03
566	000636	风华高科	700	9,562.00	0.03
567	600999	招商证券	700	9,548.00	0.03
568	603611	诺力股份	500	9,465.00	0.03
569	603993	洛阳钼业	1,800	9,360.00	0.03
570	000901	航天科技	1,000	9,320.00	0.03
571	600500	中化国际	2,100	9,282.00	0.02
572	300394	天孚通信	100	9,152.00	0.02
573	600662	外服控股	1,900	9,120.00	0.02
574	688385	复旦微电	235	9,078.05	0.02
575	688076	诺泰生物	200	8,990.00	0.02
576	600955	维远股份	500	8,975.00	0.02
577	000768	中航西飞	400	8,948.00	0.02
578	002307	北新路桥	2,100	8,904.00	0.02
579	600673	东阳光	1,200	8,796.00	0.02
580	002064	华峰化学	1,300	8,723.00	0.02
581	600170	上海建工	3,696	8,648.64	0.02
582	603601	再升科技	2,000	8,600.00	0.02
583	600332	白云山	300	8,580.00	0.02
584	000498	山东路桥	1,500	8,460.00	0.02
585	002408	齐翔腾达	1,600	8,448.00	0.02
586	002258	利尔化学	700	8,379.00	0.02
587	600623	华谊集团	1,300	8,372.00	0.02
588	688180	君实生物	200	8,366.00	0.02
589	002010	传化智联	1,800	8,316.00	0.02
590	301047	义翘神州	100	8,240.00	0.02
591	002803	吉宏股份	400	8,224.00	0.02
592	600810	神马股份	1,100	8,184.00	0.02
593	002635	安洁科技	500	8,165.00	0.02
594	603916	苏博特	800	8,152.00	0.02
595	601228	广州港	2,600	8,138.00	0.02
596	600740	山西焦化	1,600	8,064.00	0.02
597	000830	鲁西化工	800	8,024.00	0.02
598	688116	天奈科技	275	7,986.00	0.02
599	000627	天茂集团	2,800	7,952.00	0.02
600	600115	中国东航	2,000	7,760.00	0.02

601	300681	英搏尔	400	7,708.00	0.02
602	600787	中储股份	1,500	7,650.00	0.02
603	300604	长川科技	200	7,598.00	0.02
604	603979	金诚信	200	7,552.00	0.02
605	603878	武进不锈	1,000	7,550.00	0.02
606	603063	禾望电气	300	7,500.00	0.02
607	600039	四川路桥	1,000	7,490.00	0.02
608	002859	洁美科技	300	7,485.00	0.02
609	600688	上海石化	2,600	7,436.00	0.02
610	601868	中国能建	3,500	7,350.00	0.02
611	603259	药明康德	100	7,276.00	0.02
612	002493	荣盛石化	700	7,245.00	0.02
613	000869	张裕 A	300	7,242.00	0.02
614	601997	贵阳银行	1,400	7,196.00	0.02
615	000059	华锦股份	1,300	7,137.00	0.02
616	600008	首创环保	2,600	6,994.00	0.02
617	002563	森马服饰	1,200	6,924.00	0.02
618	000729	燕京啤酒	800	6,904.00	0.02
619	603517	绝味食品	257	6,903.02	0.02
620	603228	景旺电子	300	6,768.00	0.02
621	301301	川宁生物	800	6,720.00	0.02
622	603328	依顿电子	823	6,707.45	0.02
623	600757	长江传媒	900	6,705.00	0.02
624	601778	晶科科技	1,900	6,650.00	0.02
625	600643	爱建集团	1,300	6,630.00	0.02
626	600808	马钢股份	2,422	6,587.84	0.02
627	000959	首钢股份	1,900	6,574.00	0.02
628	603605	珀莱雅	66	6,560.40	0.02
629	601992	金隅集团	3,400	6,494.00	0.02
630	601818	光大银行	2,200	6,380.00	0.02
631	601200	上海环境	700	6,293.00	0.02
632	300990	同飞股份	140	6,231.40	0.02
633	000921	海信家电	300	6,120.00	0.02
634	688336	三生国健	271	6,100.21	0.02
635	601800	中国交建	800	6,080.00	0.02
636	000877	天山股份	900	6,012.00	0.02
637	600926	杭州银行	600	6,006.00	0.02
638	600000	浦发银行	900	5,958.00	0.02
639	300662	科锐国际	200	5,524.00	0.01
640	600426	华鲁恒升	200	5,518.00	0.01
641	001215	千味央厨	100	5,281.00	0.01
642	601118	海南橡胶	1,200	5,088.00	0.01
643	600023	浙能电力	1,100	5,071.00	0.01

644	300144	宋城演艺	500	4,935.00	0.01
645	001979	招商蛇口	500	4,765.00	0.01
646	002126	银轮股份	253	4,723.51	0.01
647	600129	太极集团	100	4,646.00	0.01
648	603258	电魂网络	200	4,596.00	0.01
649	002311	海大集团	100	4,491.00	0.01
650	600745	闻泰科技	100	4,231.00	0.01
651	300761	立华股份	200	4,194.00	0.01
652	600282	南钢股份	1,000	3,700.00	0.01
653	603568	伟明环保	200	3,200.00	0.01
654	002595	豪迈科技	100	2,977.00	0.01
655	000895	双汇发展	100	2,671.00	0.01
656	002179	中航光电	61	2,379.00	0.01
657	600900	长江电力	100	2,334.00	0.01
658	002831	裕同科技	84	2,310.84	0.01
659	000032	深桑达 A	100	2,118.00	0.01
660	002544	普天科技	100	2,032.00	0.01
661	688377	迪威尔	72	1,931.04	0.01
662	002384	东山精密	82	1,490.76	0.00
663	300416	苏试试验	80	1,469.60	0.00
664	002056	横店东磁	100	1,354.00	0.00
665	603317	天味食品	100	1,329.00	0.00
666	300258	精锻科技	100	1,292.00	0.00
667	600390	五矿资本	200	936.00	0.00
668	601865	福莱特	34	907.80	0.00
669	002410	广联达	38	651.32	0.00
670	000683	远兴能源	100	587.00	0.00
671	603127	昭衍新药	20	474.20	0.00
672	601988	中国银行	100	399.00	0.00
673	603612	索通发展	23	353.97	0.00
674	300232	洲明科技	35	308.00	0.00
675	600166	福田汽车	100	273.00	0.00
676	688155	先惠技术	4	222.52	0.00
677	688082	盛美上海	2	208.82	0.00
678	688363	华熙生物	3	200.79	0.00
679	688002	睿创微纳	4	176.88	0.00
680	688122	西部超导	3	159.69	0.00
681	688498	源杰科技	1	148.98	0.00
682	688513	苑东生物	2	127.56	0.00
683	300777	中简科技	4	119.32	0.00
684	688063	派能科技	1	106.00	0.00
685	688305	科德数控	1	76.45	0.00
686	002985	北摩高科	2	69.36	0.00

687	688234	天岳先进	1	66.07	0.00
688	688112	鼎阳科技	1	40.04	0.00
689	688778	厦钨新能	1	39.64	0.00
690	002906	华阳集团	1	35.25	0.00
691	688166	博瑞医药	1	35.00	0.00
692	688295	中复神鹰	1	30.31	0.00
693	688526	科前生物	1	20.38	0.00
694	300752	隆利科技	1	18.17	0.00
695	300398	飞凯材料	1	15.76	0.00
696	000708	中信特钢	1	14.04	0.00
697	300925	法本信息	1	11.75	0.00
698	002822	ST 中装	1	4.38	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600879	航天电子	900,192.00	1.66
2	002465	海格通信	807,958.00	1.49
3	002422	科伦药业	782,303.00	1.44
4	600566	济川药业	774,024.00	1.42
5	002673	西部证券	692,353.00	1.27
6	688185	康希诺	692,013.86	1.27
7	600390	五矿资本	674,391.00	1.24
8	300003	乐普医疗	673,205.00	1.24
9	600970	中材国际	662,807.00	1.22
10	002203	海亮股份	657,673.00	1.21
11	601168	西部矿业	656,571.00	1.21
12	002273	水晶光电	654,908.00	1.20
13	601231	环旭电子	653,422.00	1.20
14	002867	周大生	641,409.00	1.18
15	002019	亿帆医药	632,056.00	1.16
16	601198	东兴证券	626,755.00	1.15
17	600655	豫园股份	608,372.00	1.12
18	002080	中材科技	597,480.00	1.10
19	600728	佳都科技	597,075.00	1.10
20	300146	汤臣倍健	596,476.00	1.10

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	600109	国金证券	875,812.24	1.61
2	600160	巨化股份	851,888.80	1.57
3	601231	环旭电子	851,860.70	1.57
4	600528	中铁工业	829,375.40	1.53
5	601198	东兴证券	820,488.70	1.51
6	600879	航天电子	817,637.03	1.50
7	600909	华安证券	800,193.45	1.47
8	601128	常熟银行	797,424.71	1.47
9	600755	厦门国贸	783,877.88	1.44
10	601108	财通证券	750,825.09	1.38
11	601555	东吴证券	744,262.88	1.37
12	603613	国联股份	743,443.66	1.37
13	601997	贵阳银行	725,833.84	1.34
14	002422	科伦药业	724,153.70	1.33
15	002465	海格通信	723,980.45	1.33
16	600390	五矿资本	721,286.28	1.33
17	600566	济川药业	718,786.05	1.32
18	600177	雅戈尔	706,954.18	1.30
19	600329	达仁堂	703,068.99	1.29
20	000156	华数传媒	700,732.98	1.29

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	208,419,411.17
卖出股票收入（成交）总额	232,301,684.93

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,148.02
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,006,199.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,008,347.81

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
银华稳健 增利灵活 配置混合 发起式 A	249	72,264.74	15,653,463.00	86.99	2,340,457.11	13.01
银华稳健 增利灵活 配置混合 发起式 C	763	12,317.96	8,265,083.77	87.94	1,133,518.81	12.06
合计	1,012	27,067.71	23,918,546.77	87.32	3,473,975.92	12.68

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人 所 有 从 业 人 员 持 有 本 基 金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	551,233.10	3.06
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	21,039.26	0.22
	合计	572,272.36	2.09

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	-
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	-
	合计	-
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

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,400.14	36.51	10,001,400.14	36.51	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	36.51	10,001,400.14	36.51	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日 (2017 年 12 月 15 日) 基金份额总额	13,175,905.27	1,086,315.48
本报告期期初基金份额总额	22,648,637.44	14,707,218.60
本报告期基金总申购份额	1,244,298.84	24,972,163.56
减：本报告期基金总赎回份额	5,899,016.17	30,280,779.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,993,920.11	9,398,602.58

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

2023 年 9 月 5 日，本基金管理人发布关于首席信息官任职的公告，经本基金管理人董事会批准，邓列军先生自 2023 年 9 月 4 日起担任本基金管理人首席信息官职务。公司总经理王立新先生自 2023 年 9 月 4 日起不再代任首席信息官职务。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 45,000.00 元。该审计机构已经为本基金连续提供了 6 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

东方财富	7	440,632,789 .30	100.00	103,860.87	100.00	-
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	3	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
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	3	-	-	-	-	新增 1个 交易 单元
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	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
第一创业	1	-	-	-	-	新增 1个 交易 单元
东方证券	1	-	-	-	-	新增

							1 个交易单元
广发证券	2	-	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-	新增 1 个交易单元
平安证券	2	-	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-	新增 2 个交易单元
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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

国投证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 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
7	《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 2 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 7 月 19 日

8	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 7 月 19 日
9	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 28 日
10	《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更新 (2023 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 28 日
11	《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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 8 月 29 日
13	《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 3 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 10 月 24 日
14	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 10 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230103	13,477,997.16	3,005,485.01	13,477,997.16	3,005,485.01	10.97
	2	20230101-20231231	10,001,400.14	0.00	0.00	10,001,400.14	36.51
	3	20230104-20230726	5,652,062.86	0.00	0.00	5,652,062.86	20.63
	3	20230803-20231231	5,652,062.86	0.00	0.00	5,652,062.86	20.63
个人	1	20230727-20230802	0.00	8,042,714.24	8,042,714.24	0.00	0.00

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在

其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元,进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金,其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会;

3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,更容易触发巨额赎回条款,基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额;

4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时,基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券,可能造成证券价格波动,导致本基金的收益水平发生波动。同时,巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提,会导致基金份额净值出现大幅波动;

5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时,本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下,该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%,该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

13.1.2 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》

13.1.3 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

13.1.4 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2024 年 3 月 29 日