

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券
投资基金
2021 年年度报告

2021 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：2022 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 2022 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 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	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
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	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
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	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	21
§ 7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	51

8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
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	65
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	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§ 9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	68
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	68
§ 10 开放式基金份额变动	68
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	73
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 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	20,127,688.91 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	18,570,011.70 份	1,557,677.21 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	2021 年		2020 年		2019 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	45,285,346.32	797,899.58	181,398,602.65	356,462.25	35,675,173.20	216,141.33

现收益						
本期利润	3,784,052.02	372,959.36	207,398,013.21	387,602.49	52,235,993.46	277,731.86
加权平均基金份额本期利润	0.0258	0.3170	0.4359	0.4211	0.2578	0.1494
本期加权平均净值利润率	1.80%	19.18%	36.79%	35.62%	28.30%	17.25%
本期基金份额净值增长率	27.10%	26.66%	45.00%	44.51%	34.84%	34.45%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	14,587,650.67	1,190,375.01	132,631,510.94	235,229.86	-48,765,272.18	-195,448.75
期末可供分配基金份额利润	0.7855	0.7642	0.2787	0.2676	-0.1026	-0.1072
期末基金资产净值	33,157,662.37	2,748,052.22	668,556,155.83	1,224,479.33	460,608,683.17	1,758,171.51
期末基金份额净值	1.7855	1.7642	1.4048	1.3929	0.9688	0.9639

3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	基金份额累计净值增长率	78.55%	76.42%	40.48%	39.29%	-3.12%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.89%	0.85%	1.43%	0.36%	-2.32%	0.49%
过去六个月	5.86%	1.14%	-0.09%	0.47%	5.95%	0.67%
过去一年	27.10%	1.22%	1.11%	0.54%	25.99%	0.68%
过去三年	148.50%	1.24%	33.35%	0.62%	115.15%	0.62%
自基金合同生效起至今	78.55%	1.21%	17.78%	0.63%	60.77%	0.58%

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	-0.98%	0.85%	1.43%	0.36%	-2.41%	0.49%
过去六个月	5.68%	1.14%	-0.09%	0.47%	5.77%	0.67%
过去一年	26.66%	1.22%	1.11%	0.54%	25.55%	0.68%
过去三年	146.09%	1.24%	33.35%	0.62%	112.74%	0.62%
自基金合同生效起至今	76.42%	1.21%	17.78%	0.63%	58.64%	0.58%

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%

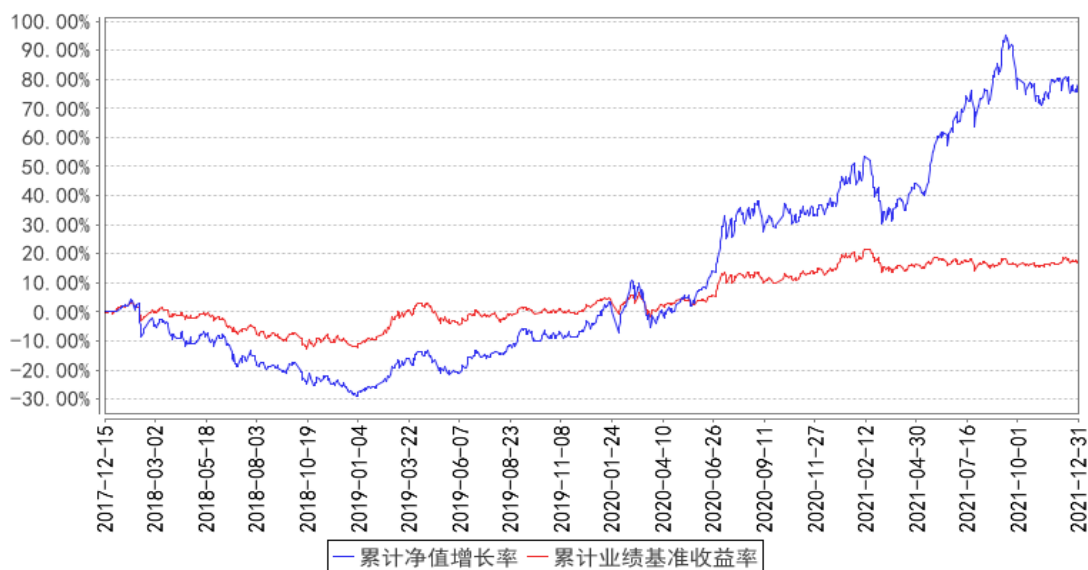
中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券市场中选取 800 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模居前、流动性良好的股票，目前中证 800 指数样本覆盖了沪深市场近八成左右的市值，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性。

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

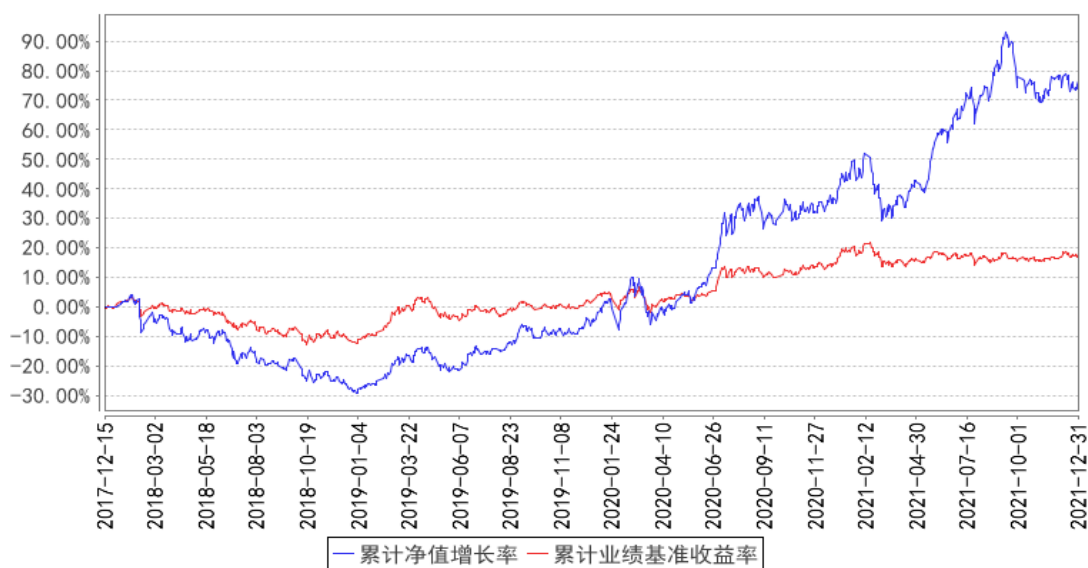
本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 0%-95% 的股票资产，其余资产主要投资于权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具。因此，“中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

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

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



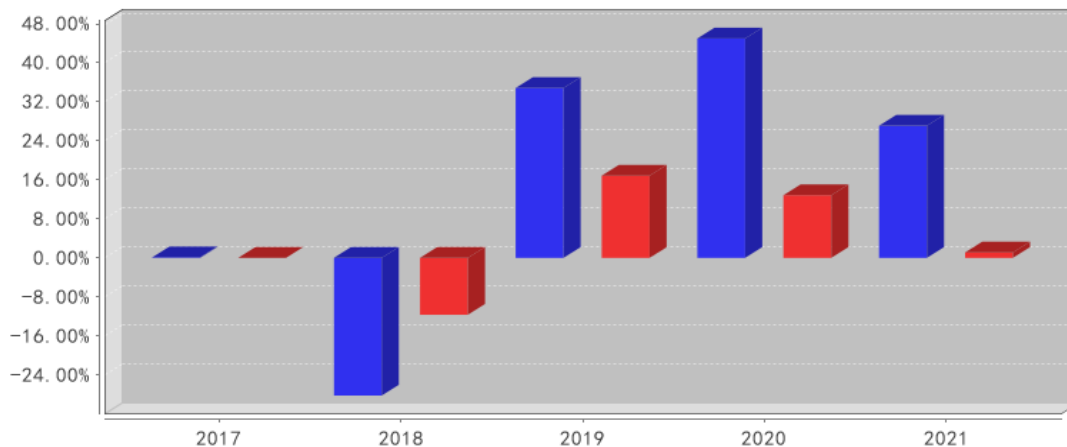
银华稳健增利灵活配置混合发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

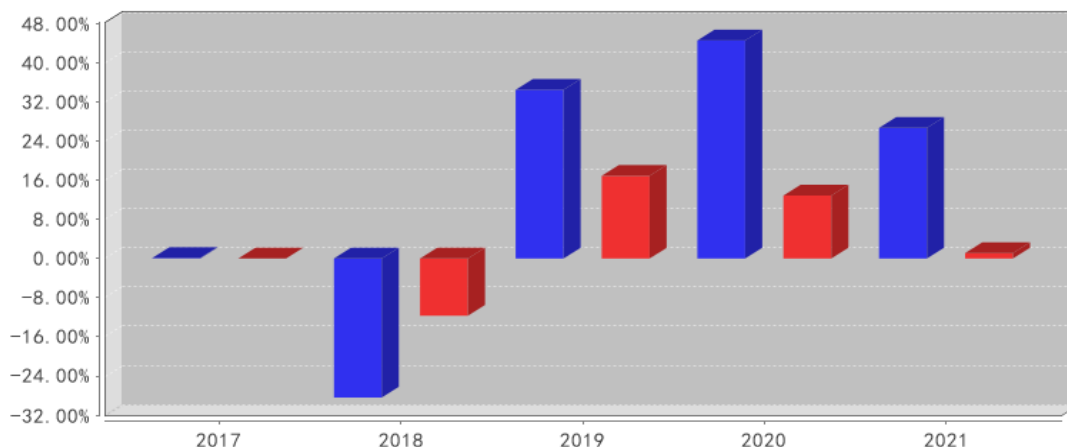
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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A净值增长率
■ 银华稳健增利灵活配置混合发起式A业绩基准收益率

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



■ 银华稳健增利灵活配置混合发起式C净值增长率
■ 银华稳健增利灵活配置混合发起式C业绩基准收益率

注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2021年度、2020年度、2019年度会计期间未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7

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

截至 2021 年 12 月 31 日,本基金管理人管理着 159 只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金(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)、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金(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)、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互

联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华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、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊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。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	本基金的	2017 年	-	13.5 年	硕士学位。2008 年 7 月至 2009 年 3 月任

女士	基金经理	12 月 15 日			<p>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 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日起兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 12 月 10 日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
张 凯	本基金的	2021 年 9	-	12.5 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月

先生	基金经理	月 28 日		<p>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 日起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 日起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 日起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 日起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</p>
----	------	--------	--	--

					证券投资基金基金经理，自 2021 年 12 月 20 日起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 日起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。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	-	9.5 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、银华信息科技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。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《证券投资基金管理人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 3 次，原因是量化投资组合和指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 基金份额净值为 1.7855 元，本报告期基金份额净值增长率为 27.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.11%；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 1.7642 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.66%，同期业绩比较基准收益率为 1.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，2021 年全球层面的核心主题仍然是在疫情约束下的经济活动复苏。伴随疫苗接种率的提升与变异病毒的更替，全球防疫措施整体呈现放松、反复、收紧的阶段性波动状态。

对于海外多数国家而言，阶段性防控收紧+持续性货币宽松成为维持疫情防控与经济活动平衡的主要思路。而对于国内而言，坚持动态清零+货币整体平衡的策略依旧运行良好。在这种差异下，全球通胀率整体提升，中国的出口水平依旧维持在较高位。进入 2022 年之后，我们认为潜在变化因素仍然在于人类对疫情的认知提升，从而带来疫情约束的宽松。这些变化都将对市场产生影响。

企业估值层面，2021 年的全球市场仍是受货币宽松浪潮与通胀提升影响明显。上游资源类、制造类公司估值水平提升明显。国内市场也与之相关联，上游行业的业绩与估值都经历了一次提升，其他行业板块则主要是受政策性、结构性变化的影响。进入 2022 年后，我们认为通胀的影响边际上在减弱，行业性、结构性的影响将会更加主流化。风险层面，我们认为 2022 年的主要风险来自于海外市场风险的传递、全球地缘摩擦事件的发生。基于上述判断，我们认为 A 股市场仍将存在机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了监察稽核机制，根据不同基金的特点与公司业务发展情况，及时界定新的合规风险点，并在年初制定监察稽核工作计划及重点，以专项检查或抽查的形式对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务环节进行检查。

本基金管理人始终坚持以法律法规及公司制度为基础，不断查缺补漏，确保本基金的安全、合规运作，在投资研究交易环节，主要包括对研究报告合规性、股票库建立及完善情况、基金投资比例的日常监控情况、关联交易的日常维护情况以及公平交易执行情况的合规检查；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值等业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、跟踪检查报告或监察提示函的形式，及时将潜在风险通报部门总监、分管领导、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金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，出现该情况的时间范围为 2021 年 5 月 18 日至 2021 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，本基金的基金管理人——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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2021 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（2022）审字第 61329181_A54 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<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 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	治理层负责监督银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</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	王珊珊	贺耀
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,705,132.21	51,480,153.18
结算备付金		161,269.72	13,456,694.14
存出保证金		10,321.18	2,902,172.39
交易性金融资产	7.4.7.2	32,292,751.11	602,987,361.70
其中：股票投资		32,292,751.11	602,987,361.70
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	648.81	12,150.95
应收股利		-	-
应收申购款		10,113.76	822.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		36,180,236.79	670,839,354.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		180,843.74	3,937.24
应付管理人报酬		16,283.34	330,221.16
应付托管费		4,070.83	82,555.30
应付销售服务费		822.46	340.68
应付交易费用	7.4.7.7	27,498.73	476,665.19
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	45,003.10	165,000.00
负债合计		274,522.20	1,058,719.57
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	20,127,688.91	476,790,901.49
未分配利润	7.4.7.10	15,778,025.68	192,989,733.67
所有者权益合计		35,905,714.59	669,780,635.16
负债和所有者权益总计		36,180,236.79	670,839,354.73

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 20,127,688.91 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 18,570,011.70 份，基金份额净值 1.7855 元；银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额总额 1,557,677.21 份，基金份额净值 1.7642 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		8,705,761.51	221,254,062.83
1. 利息收入		161,652.98	462,534.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	161,652.98	443,239.23
债券利息收入		-	19,295.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,933,702.60	194,751,274.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	50,594,983.59	178,853,538.56
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-8,100.00
资产支持证券投资	7.4.7.13.3	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-1,033,133.98	10,828,784.47
股利收益	7.4.7.16	371,852.99	5,077,050.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-41,926,234.52	26,030,550.80

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	536,640.45	9,703.38
减：二、费用		4,548,750.13	13,468,447.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,327,828.84	3,371,831.72
2. 托管费	7.4.10.2.2	331,957.22	842,957.98
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,794.09	3,814.04
4. 交易费用	7.4.7.19	2,832,701.63	9,043,927.78
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,916.88	39,073.61
7. 其他费用	7.4.7.20	47,551.47	166,842.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,157,011.38	207,785,615.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,157,011.38	207,785,615.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	476,790,901.49	192,989,733.67	669,780,635.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,157,011.38	4,157,011.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-456,663,212.58	-181,368,719.37	-638,031,931.95
其中：1. 基金申购款	20,598,845.34	14,576,149.82	35,174,995.16
2. 基金赎回款	-477,262,057.92	-195,944,869.19	-673,206,927.11
四、本期向基金	-	-	-

份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	20,127,688.91	15,778,025.68	35,905,714.59
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	477,247,703.07	-14,880,848.39	462,366,854.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	207,785,615.70	207,785,615.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-456,801.58	84,966.36	-371,835.22
其中：1. 基金申购款	4,535,529.51	817,389.90	5,352,919.41
2. 基金赎回款	-4,992,331.09	-732,423.54	-5,724,754.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	476,790,901.49	192,989,733.67	669,780,635.16

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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。

每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于股指期货合约平仓和到期交割日确认，并按平仓和到期交割日

成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

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

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

7.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

7.4.6.3 企业所得税

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

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

7.4.6.4 个人所得税

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

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

人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	3,705,132.21	51,480,153.18
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	3,705,132.21	51,480,153.18

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,869,910.05	32,292,751.11	422,841.06
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	31,869,910.05	32,292,751.11	422,841.06
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	561,278,766.12	602,987,361.70	41,708,595.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	561,278,766.12	602,987,361.70	41,708,595.58

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	
项目	上年度末 2020年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	18,206,120.00	-	-	
其中：股指期货投资	18,206,120.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	18,206,120.00	-	-	

注：在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融工具项下的股指期货投资按抵销后的净额列示，为人民币零元。于 2021 年 12 月 31 日，本基金无股指期货投资（于 2020 年 12 月 31 日，IC2101 买入持仓量 5 手，合约市值人民币 6,343,800.00 元，公允价值变动人民币 159,280.00 元；IC2103 买入持仓量 10 手，合约市值人民币 12,502,800.00 元，公允价值变动人民币 481,200.00 元）。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	564.24	5,855.27
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	79.51	6,258.39
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	5.06	37.29
合计	648.81	12,150.95

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	27,498.73	476,665.19
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	27,498.73	476,665.19

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3.10	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	45,000.00	165,000.00
合计	45,003.10	165,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	475,911,840.40	475,911,840.40
本期申购	16,841,313.40	16,841,313.40

本期赎回（以“-”号填列）	-474,183,142.10	-474,183,142.10
-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	18,570,011.70	18,570,011.70

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	879,061.09	879,061.09
本期申购	3,757,531.94	3,757,531.94
本期赎回（以“-”号填列）	-3,078,915.82	-3,078,915.82
-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	1,557,677.21	1,557,677.21

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

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	132,631,510.94	60,012,804.49	192,644,315.43
本期利润	45,285,346.32	-41,501,294.30	3,784,052.02
本期基金份额交易产生的变动数	-159,709,604.75	-22,131,112.03	-181,840,716.78
其中：基金申购款	13,591,530.34	-1,578,818.38	12,012,711.96
基金赎回款	-173,301,135.09	-20,552,293.65	-193,853,428.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,207,252.51	-3,619,601.84	14,587,650.67

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	235,229.86	110,188.38	345,418.24
本期利润	797,899.58	-424,940.22	372,959.36
本期基金份额	456,958.16	15,039.25	471,997.41

交易产生的变动数			
其中：基金申购款	2,711,011.03	-147,573.17	2,563,437.86
基金赎回款	-2,254,052.87	162,612.42	-2,091,440.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,490,087.60	-299,712.59	1,190,375.01

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	92,545.61	229,878.70
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	67,333.08	98,719.93
其他	1,774.29	114,640.60
合计	161,652.98	443,239.23

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	50,594,983.59	178,853,538.56
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	50,594,983.59	178,853,538.56

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,829,521,318.77	4,134,667,204.51
减:卖出股票成本总额	1,778,926,335.18	3,955,813,665.95
买卖股票差价收入	50,594,983.59	178,853,538.56

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	-	-8,100.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	-8,100.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	-	3,932,620.00
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	-	3,808,100.00
减:应收利息总额	-	132,620.00
买卖债券差价收入	-	-8,100.00

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注:无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	-1,033,133.98	10,828,784.47

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	371,852.99	5,077,050.99
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	371,852.99	5,077,050.99

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-41,285,754.52	25,390,070.80
股票投资	-41,285,754.52	25,390,070.80
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	-640,480.00	640,480.00
权证投资	-	-
期货投资	-640,480.00	640,480.00

3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-41,926,234.52	26,030,550.80

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	529,248.43	7,752.40
基金转换费收入	6,637.65	1,950.98
其他	754.37	-
合计	536,640.45	9,703.38

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	2,832,701.63	9,043,927.78
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,832,701.63	9,043,927.78

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	-	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,551.47	1,842.00
合计	47,551.47	166,842.00

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

业”)	
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	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
银华长安资本管理(北京)有限公司	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的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

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 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,327,828.84	3,371,831.72
其中：支付销售机构的客户维护费	13,295.87	7,094.34

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 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	331,957.22	842,957.98

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	512.35	512.35
中国工商银行	-	433.36	433.36
合计	-	945.71	945.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置 混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置 混合发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	55.46	55.46
中国工商银行	-	729.35	729.35
合计	-	784.81	784.81

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2021年1月1日至2021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	53.86%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日(2017年12月15日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.10%	-

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	3,705,132.21	92,545.61	51,480,153.18	229,878.70

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(2021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
002683	广东宏大	2021年12月20日	重大事项停牌	30.12	2022年1月4日	31.00	960	28,129.80	28,915.20	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。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随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

风险，有效保障基金持有人利益。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	3,705,132.21	-	-	-	3,705,132.21
结算备付金	161,269.72	-	-	-	161,269.72
存出保证金	10,321.18	-	-	-	10,321.18
交易性金融资产	-	-	-	32,292,751.11	32,292,751.11
应收利息	-	-	-	648.81	648.81
应收申购款	-	-	-	10,113.76	10,113.76
资产总计	3,876,723.11	-	-	32,303,513.68	36,180,236.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	180,843.74	180,843.74
应付管理人报酬	-	-	-	16,283.34	16,283.34
应付托管费	-	-	-	4,070.83	4,070.83
应付销售服务费	-	-	-	822.46	822.46

应付交易费用	-	-	-	27,498.73	27,498.73
其他负债	-	-	-	45,003.10	45,003.10
负债总计	-	-	-	274,522.20	274,522.20
利率敏感度缺口	3,876,723.11	-	-	32,028,991.48	35,905,714.59
上年度末 2020 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	51,480,153.18	-	-	-	51,480,153.18
结算备付金	13,456,694.14	-	-	-	13,456,694.14
存出保证金	75,182.39	-	-	2,826,990.00	2,902,172.39
交易性金融资产	-	-	-	602,987,361.70	602,987,361.70
应收利息	-	-	-	12,150.95	12,150.95
应收申购款	-	-	-	822.37	822.37
资产总计	65,012,029.71	-	-	605,827,325.02	670,839,354.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,937.24	3,937.24
应付管理人报酬	-	-	-	330,221.16	330,221.16
应付托管费	-	-	-	82,555.30	82,555.30
应付销售服务费	-	-	-	340.68	340.68
应付交易费用	-	-	-	476,665.19	476,665.19
其他负债	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	-	-	-	1,058,719.57	1,058,719.57
利率敏感度缺口	65,012,029.71	-	-	604,768,605.45	669,780,635.16

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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	32,292,751.11	89.94	602,987,361.70	90.03
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	32,292,751.11	89.94	602,987,361.70	90.03

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	3,119,446.82	66,966,568.58
	业绩比较基准下降 5%	-3,119,446.82	-66,966,568.58

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

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

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 32,263,835.91 元，属于第二层次的余额为人民币 28,915.20 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（上年度末：第一层次人民币 600,266,114.72 元，第二层次人民币 702,864.79 元，第三层次人民币 2,018,382.19 元）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具转出第三层次公允价值的金额为人民币 97,800.52 元（上年度：转出第三层次的金额为人民币 75,943.00 元）。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

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人民币 5,000 万元的情形，出现该情况的时间范围为 2021 年 5 月 18 日至 2021 年 12 月 31 日。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 25 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	32,292,751.11	89.26
	其中：股票	32,292,751.11	89.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,866,401.93	10.69
8	其他各项资产	21,083.75	0.06
9	合计	36,180,236.79	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	135,207.36	0.38
B	采矿业	1,831,373.24	5.10
C	制造业	23,545,869.42	65.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	932,922.38	2.60
E	建筑业	398,607.03	1.11
F	批发和零售业	604,708.87	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	605,985.77	1.69
H	住宿和餐饮业	101,980.68	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,766,655.50	4.92
J	金融业	1,049,106.75	2.92
K	房地产业	166,977.33	0.47
L	租赁和商务服务业	377,749.77	1.05
M	科学研究和技术服务业	57,077.72	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	122,639.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	36,197.63	0.10
R	文化、体育和娱乐业	498,033.27	1.39
S	综合	61,659.39	0.17
	合计	32,292,751.11	89.94

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	284	582,200.00	1.62
2	600765	中航重机	9,748	492,176.52	1.37
3	600008	首创环保	109,030	371,792.30	1.04
4	600862	中航高科	10,354	370,259.04	1.03
5	300294	博雅生物	9,100	348,985.00	0.97
6	600884	杉杉股份	10,036	328,879.72	0.92
7	688099	晶晨股份	2,463	320,682.60	0.89
8	000988	华工科技	11,369	316,740.34	0.88
9	688200	华峰测控	590	302,021.00	0.84
10	300327	中颖电子	4,431	300,864.90	0.84
11	603027	千禾味业	11,800	284,144.00	0.79
12	603979	金诚信	13,191	283,342.68	0.79
13	603486	科沃斯	1,764	266,275.80	0.74
14	300390	天华超净	3,280	265,680.00	0.74
15	002648	卫星化学	6,473	259,114.19	0.72
16	300699	光威复材	3,040	256,819.20	0.72
17	002709	天赐材料	2,171	248,905.15	0.69
18	002028	思源电气	4,600	226,366.00	0.63
19	300750	宁德时代	383	225,204.00	0.63
20	600623	华谊集团	24,240	220,584.00	0.61
21	688005	容百科技	1,887	218,099.46	0.61
22	600436	片仔癀	493	215,514.95	0.60
23	600057	厦门象屿	24,916	211,536.84	0.59
24	300755	华致酒行	4,097	205,177.76	0.57
25	603799	华友钴业	1,859	205,066.29	0.57
26	300316	晶盛机电	2,933	203,843.50	0.57
27	600089	特变电工	9,592	203,062.64	0.57
28	688008	澜起科技	2,377	199,358.99	0.56
29	000932	华菱钢铁	39,000	199,290.00	0.56
30	601689	拓普集团	3,630	192,390.00	0.54
31	688033	天宜上佳	5,769	190,665.45	0.53
32	600497	驰宏锌锗	38,100	190,119.00	0.53
33	002597	金禾实业	3,700	189,995.00	0.53
34	300747	锐科激光	3,189	188,501.79	0.52
35	601618	中国中冶	49,004	187,685.32	0.52
36	000960	锡业股份	9,600	187,488.00	0.52
37	300408	三环集团	4,200	187,320.00	0.52
38	601225	陕西煤业	14,782	180,340.40	0.50
39	603260	合盛硅业	1,361	179,611.17	0.50
40	600116	三峡水利	15,400	179,564.00	0.50
41	300443	金雷股份	3,100	179,056.00	0.50
42	603517	绝味食品	2,600	177,658.00	0.49

43	000650	仁和药业	18,800	175,216.00	0.49
44	600372	中航电子	7,766	173,880.74	0.48
45	688357	建龙微纳	898	172,362.12	0.48
46	300861	美畅股份	2,200	171,094.00	0.48
47	600728	佳都科技	20,500	170,765.00	0.48
48	002385	大北农	16,200	169,938.00	0.47
49	300260	新莱应材	3,586	169,151.62	0.47
50	688301	奕瑞科技	339	168,449.10	0.47
51	688030	山石网科	5,570	165,206.20	0.46
52	601128	常熟银行	24,569	162,401.09	0.45
53	002236	大华股份	6,818	160,086.64	0.45
54	002064	华峰化学	15,300	159,732.00	0.44
55	688122	西部超导	1,646	159,563.24	0.44
56	002129	中环股份	3,820	159,485.00	0.44
57	601838	成都银行	13,270	159,240.00	0.44
58	000733	振华科技	1,274	158,332.72	0.44
59	300037	新宙邦	1,400	158,200.00	0.44
60	300601	康泰生物	1,600	157,664.00	0.44
61	300474	景嘉微	1,035	157,527.00	0.44
62	002396	星网锐捷	6,601	155,585.57	0.43
63	600183	生益科技	6,600	155,430.00	0.43
64	300122	智飞生物	1,237	154,130.20	0.43
65	000709	河钢股份	61,939	152,369.94	0.42
66	000977	浪潮信息	4,239	151,883.37	0.42
67	000568	泸州老窖	585	148,513.95	0.41
68	002938	鹏鼎控股	3,500	148,505.00	0.41
69	002756	永兴材料	1,000	148,020.00	0.41
70	300775	三角防务	3,000	146,670.00	0.41
71	002472	双环传动	5,270	145,346.60	0.40
72	600487	亨通光电	9,595	145,076.40	0.40
73	600567	山鹰国际	44,011	144,796.19	0.40
74	002212	天融信	7,448	142,778.16	0.40
75	688388	嘉元科技	1,135	142,499.25	0.40
76	300369	绿盟科技	8,956	142,042.16	0.40
77	000825	太钢不锈	20,100	141,504.00	0.39
78	002739	万达电影	9,100	140,868.00	0.39
79	600256	广汇能源	21,530	140,806.20	0.39
80	300059	东方财富	3,719	138,012.09	0.38
81	300709	精研科技	2,300	137,885.00	0.38
82	002812	恩捷股份	550	137,720.00	0.38
83	600282	南钢股份	37,125	137,362.50	0.38
84	000039	中集集团	8,000	137,280.00	0.38

85	000598	兴蓉环境	21,700	137,144.00	0.38
86	600219	南山铝业	29,095	137,037.45	0.38
87	603876	鼎胜新材	3,600	135,540.00	0.38
88	603666	亿嘉和	1,800	135,216.00	0.38
89	605111	新洁能	757	134,821.70	0.38
90	300223	北京君正	1,000	134,000.00	0.37
91	600428	中远海特	26,500	133,560.00	0.37
92	600782	新钢股份	25,200	133,056.00	0.37
93	002203	海亮股份	10,700	133,001.00	0.37
94	000807	云铝股份	11,900	132,923.00	0.37
95	600111	北方稀土	2,900	132,820.00	0.37
96	000630	铜陵有色	37,900	131,892.00	0.37
97	600581	八一钢铁	21,200	131,652.00	0.37
98	600516	方大炭素	12,000	129,840.00	0.36
99	000959	首钢股份	22,596	129,475.08	0.36
100	000858	五粮液	580	129,142.80	0.36
101	002120	韵达股份	6,285	128,591.10	0.36
102	600452	涪陵电力	6,300	126,882.00	0.35
103	300409	道氏技术	5,210	126,342.50	0.35
104	002635	安洁科技	7,400	126,022.00	0.35
105	002850	科达利	766	122,820.44	0.34
106	603456	九洲药业	2,113	118,877.38	0.33
107	600141	兴发集团	3,100	117,428.00	0.33
108	600438	通威股份	2,611	117,390.56	0.33
109	601898	中煤能源	18,500	116,365.00	0.32
110	002594	比亚迪	431	115,559.72	0.32
111	601666	平煤股份	13,575	113,622.75	0.32
112	600809	山西汾酒	355	112,101.90	0.31
113	000783	长江证券	14,727	111,041.58	0.31
114	000877	天山股份	7,075	108,318.25	0.30
115	000519	中兵红箭	3,753	100,092.51	0.28
116	601699	潞安环能	8,804	99,573.24	0.28
117	300571	平治信息	1,692	99,083.52	0.28
118	300253	卫宁健康	5,869	98,364.44	0.27
119	002254	泰和新材	5,000	98,050.00	0.27
120	300568	星源材质	2,648	97,261.04	0.27
121	002153	石基信息	3,304	94,956.96	0.26
122	300595	欧普康视	1,600	91,792.00	0.26
123	002539	云图控股	6,900	91,563.00	0.26
124	601992	金隅集团	31,936	90,698.24	0.25
125	688598	金博股份	255	90,535.20	0.25
126	603599	广信股份	2,300	89,700.00	0.25

127	601882	海天精工	3,600	89,172.00	0.25
128	002978	安宁股份	2,101	88,830.28	0.25
129	603688	石英股份	1,400	88,354.00	0.25
130	601233	桐昆股份	4,133	87,536.94	0.24
131	002832	比音勒芬	3,400	86,530.00	0.24
132	600596	新安股份	3,348	83,666.52	0.23
133	000403	派林生物	2,928	82,071.84	0.23
134	600426	华鲁恒升	2,600	81,380.00	0.23
135	002497	雅化集团	2,800	80,248.00	0.22
136	601828	美凯龙	8,800	77,528.00	0.22
137	603938	三孚股份	2,107	77,516.53	0.22
138	002556	辉隆股份	6,000	77,220.00	0.22
139	600754	锦江酒店	1,314	77,000.40	0.21
140	000012	南玻A	7,600	75,468.00	0.21
141	603305	旭升股份	1,500	74,820.00	0.21
142	002545	东方铁塔	8,200	74,784.00	0.21
143	601068	中铝国际	12,200	74,420.00	0.21
144	600389	江山股份	1,800	74,016.00	0.21
145	300432	富临精工	2,500	73,500.00	0.20
146	002206	海利得	8,200	72,816.00	0.20
147	603225	新凤鸣	4,900	72,765.00	0.20
148	000683	远兴能源	9,964	72,737.20	0.20
149	002326	永太科技	1,400	71,694.00	0.20
150	300296	利亚德	6,991	71,657.75	0.20
151	000623	吉林敖东	3,856	71,220.32	0.20
152	603256	宏和科技	8,300	71,048.00	0.20
153	002643	万润股份	3,000	70,920.00	0.20
154	688308	欧科亿	1,000	70,680.00	0.20
155	603379	三美股份	3,100	70,618.00	0.20
156	600810	神马股份	5,617	69,931.65	0.19
157	300821	东岳硅材	3,800	69,464.00	0.19
158	300590	移为通信	2,400	69,240.00	0.19
159	600176	中国巨石	3,800	69,160.00	0.19
160	002601	龙佰集团	2,400	68,616.00	0.19
161	600702	舍得酒业	300	68,190.00	0.19
162	300873	海晨股份	1,374	67,463.40	0.19
163	000062	深圳华强	3,900	67,197.00	0.19
164	300596	利安隆	1,500	67,140.00	0.19
165	600739	辽宁成大	3,400	66,368.00	0.18
166	600036	招商银行	1,322	64,394.62	0.18
167	300751	迈为股份	100	64,230.00	0.18
168	601577	长沙银行	8,200	64,042.00	0.18

169	601019	山东出版	10,400	63,960.00	0.18
170	002368	太极股份	2,300	63,342.00	0.18
171	600004	白云机场	5,200	62,712.00	0.17
172	000009	中国宝安	4,273	61,659.39	0.17
173	600030	中信证券	2,300	60,743.00	0.17
174	000636	风华高科	2,031	60,523.80	0.17
175	601615	明阳智能	2,300	60,030.00	0.17
176	688029	南微医学	280	59,547.60	0.17
177	300979	华利集团	666	59,307.30	0.17
178	600383	金地集团	4,538	58,857.86	0.16
179	002916	深南电路	482	58,717.24	0.16
180	600271	航天信息	4,338	58,085.82	0.16
181	300418	昆仑万维	2,500	57,875.00	0.16
182	600066	宇通客车	5,200	57,304.00	0.16
183	600985	淮北矿业	5,100	57,018.00	0.16
184	002409	雅克科技	700	56,819.00	0.16
185	600741	华域汽车	2,000	56,600.00	0.16
186	600779	水井坊	468	56,155.32	0.16
187	600019	宝钢股份	7,831	56,069.96	0.16
188	600166	福田汽车	16,100	55,384.00	0.15
189	600885	宏发股份	741	55,308.24	0.15
190	600787	中储股份	8,800	54,912.00	0.15
191	600339	中油工程	17,700	54,516.00	0.15
192	601200	上海环境	4,300	54,137.00	0.15
193	000685	中山公用	6,100	53,985.00	0.15
194	600808	马钢股份	14,600	53,874.00	0.15
195	002049	紫光国微	239	53,775.00	0.15
196	300133	华策影视	7,869	53,273.13	0.15
197	300379	东方通	1,800	53,154.00	0.15
198	601168	西部矿业	3,900	53,079.00	0.15
199	688111	金山办公	200	53,000.00	0.15
200	603588	高能环境	3,000	52,710.00	0.15
201	688396	华润微	810	52,326.00	0.15
202	300363	博腾股份	584	52,238.80	0.15
203	600968	海油发展	17,800	52,154.00	0.15
204	600893	航发动力	797	50,577.62	0.14
205	002407	多氟多	1,123	50,523.77	0.14
206	603185	上机数控	300	50,094.00	0.14
207	002920	德赛西威	350	49,528.50	0.14
208	002299	圣农发展	2,010	48,581.70	0.14
209	002833	弘亚数控	1,500	48,270.00	0.13
210	000829	天音控股	2,584	47,648.96	0.13

211	300973	立高食品	360	47,548.80	0.13
212	300415	伊之密	2,200	46,728.00	0.13
213	000761	本钢板材	11,100	46,620.00	0.13
214	601865	福莱特	800	46,352.00	0.13
215	600171	上海贝岭	1,800	46,188.00	0.13
216	002410	广联达	718	45,937.64	0.13
217	603259	药明康德	384	45,534.72	0.13
218	002493	荣盛石化	2,500	45,400.00	0.13
219	000901	航天科技	4,338	44,811.54	0.12
220	688007	光峰科技	1,300	44,655.00	0.12
221	603816	顾家家居	575	44,367.00	0.12
222	300772	运达股份	1,000	43,980.00	0.12
223	003022	联泓新科	1,200	43,728.00	0.12
224	002312	川发龙蟒	3,300	43,164.00	0.12
225	000983	山西焦煤	5,200	43,004.00	0.12
226	600546	山煤国际	5,201	42,700.21	0.12
227	600395	盘江股份	5,860	42,602.20	0.12
228	600845	宝信软件	700	42,581.00	0.12
229	600188	兖矿能源	1,800	42,354.00	0.12
230	601888	中国中免	193	42,346.13	0.12
231	601001	晋控煤业	4,400	42,284.00	0.12
232	600136	当代文体	6,208	41,593.60	0.12
233	600348	华阳股份	3,500	41,475.00	0.12
234	002859	洁美科技	1,100	40,920.00	0.11
235	601567	三星医疗	2,500	40,775.00	0.11
236	601899	紫金矿业	4,201	40,749.70	0.11
237	000681	视觉中国	1,700	40,630.00	0.11
238	002179	中航光电	400	40,224.00	0.11
239	002977	天箭科技	500	40,030.00	0.11
240	603986	兆易创新	227	39,917.95	0.11
241	601872	招商轮船	9,700	39,770.00	0.11
242	600887	伊利股份	956	39,635.76	0.11
243	002449	国星光电	3,558	38,355.24	0.11
244	601808	中海油服	2,500	37,500.00	0.10
245	601512	中新集团	4,079	36,914.95	0.10
246	002271	东方雨虹	700	36,876.00	0.10
247	300696	爱乐达	700	36,358.00	0.10
248	600195	中牧股份	2,719	35,537.33	0.10
249	002759	天际股份	1,200	35,160.00	0.10
250	000156	华数传媒	4,147	35,083.62	0.10
251	002124	天邦股份	5,400	34,776.00	0.10
252	002371	北方华创	100	34,702.00	0.10

253	600132	重庆啤酒	222	33,593.04	0.09
254	603198	迎驾贡酒	469	32,572.05	0.09
255	600757	长江传媒	6,076	32,506.60	0.09
256	600390	五矿资本	6,100	32,452.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	2,193	32,434.47	0.09
258	601601	中国太保	1,187	32,191.44	0.09
259	601088	中国神华	1,395	31,415.40	0.09
260	300398	飞凯材料	1,300	31,408.00	0.09
261	002088	鲁阳节能	1,200	31,200.00	0.09
262	603881	数据港	843	31,123.56	0.09
263	601012	隆基股份	359	30,945.80	0.09
264	300777	中简科技	500	30,940.00	0.09
265	300613	富瀚微	189	30,816.45	0.09
266	600309	万华化学	300	30,300.00	0.08
267	603712	七一二	693	30,006.90	0.08
268	300654	世纪天鸿	3,100	29,481.00	0.08
269	002683	广东宏大	960	28,915.20	0.08
270	601318	中国平安	563	28,380.83	0.08
271	600674	川投能源	2,200	27,500.00	0.08
272	603713	密尔克卫	200	26,956.00	0.08
273	601668	中国建筑	5,391	26,955.00	0.08
274	002241	歌尔股份	498	26,941.80	0.08
275	000063	中兴通讯	800	26,800.00	0.07
276	002025	航天电器	318	26,696.10	0.07
277	601117	中国化学	2,181	26,172.00	0.07
278	600745	闻泰科技	200	25,860.00	0.07
279	601158	重庆水务	3,924	25,152.84	0.07
280	300655	晶瑞电材	600	25,068.00	0.07
281	600662	外服控股	3,499	25,052.84	0.07
282	600258	首旅酒店	956	24,980.28	0.07
283	300662	科锐国际	400	24,884.00	0.07
284	002245	蔚蓝锂芯	900	24,759.00	0.07
285	002174	游族网络	1,600	24,384.00	0.07
286	688016	心脉医疗	98	24,376.52	0.07
287	002002	鸿达兴业	4,010	24,300.60	0.07
288	600859	王府井	900	24,300.00	0.07
289	002408	齐翔腾达	2,300	24,150.00	0.07
290	600298	安琪酵母	400	24,144.00	0.07
291	600038	中直股份	300	24,090.00	0.07
292	002291	星期六	1,200	23,952.00	0.07
293	600663	陆家嘴	2,200	23,892.00	0.07
294	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.06

295	600456	宝钛股份	323	23,184.94	0.06
296	688508	芯朋微	200	23,172.00	0.06
297	605266	健之佳	300	22,971.00	0.06
298	000656	金科股份	5,100	22,848.00	0.06
299	000625	长安汽车	1,500	22,785.00	0.06
300	002518	科士达	900	22,590.00	0.06
301	688166	博瑞医药	611	22,429.81	0.06
302	300055	万邦达	1,700	22,134.00	0.06
303	600416	湘电股份	1,000	21,890.00	0.06
304	601166	兴业银行	1,144	21,781.76	0.06
305	688055	龙腾光电	3,170	21,714.50	0.06
306	002125	湘潭电化	1,900	21,660.00	0.06
307	002867	周大生	1,213	21,567.14	0.06
308	601208	东材科技	1,234	21,409.90	0.06
309	603043	广州酒家	881	21,196.86	0.06
310	002065	东华软件	2,700	21,060.00	0.06
311	300666	江丰电子	400	21,032.00	0.06
312	601818	光大银行	6,273	20,826.36	0.06
313	600776	东方通信	1,800	20,718.00	0.06
314	300015	爱尔眼科	490	20,717.20	0.06
315	600160	巨化股份	1,600	20,656.00	0.06
316	603659	璞泰来	128	20,558.08	0.06
317	600760	中航沈飞	300	20,412.00	0.06
318	601816	京沪高铁	4,185	20,213.55	0.06
319	600346	恒力石化	866	19,892.02	0.06
320	601162	天风证券	4,800	19,440.00	0.05
321	600970	中材国际	1,700	19,431.00	0.05
322	600297	广汇汽车	7,234	19,314.78	0.05
323	000937	冀中能源	3,500	19,285.00	0.05
324	002180	纳思达	400	19,104.00	0.05
325	000738	航发控制	625	18,925.00	0.05
326	600570	恒生电子	300	18,645.00	0.05
327	002293	罗莱生活	1,300	18,629.00	0.05
328	601390	中国中铁	3,192	18,481.68	0.05
329	002192	融捷股份	140	18,221.00	0.05
330	002304	洋河股份	110	18,120.30	0.05
331	600977	中国电影	1,400	17,934.00	0.05
332	601169	北京银行	3,939	17,489.16	0.05
333	600060	海信视像	1,300	17,485.00	0.05
334	002672	东江环保	2,300	16,928.00	0.05
335	000026	飞亚达	1,400	16,590.00	0.05
336	002042	华孚时尚	3,600	16,452.00	0.05

337	001979	招商蛇口	1,227	16,368.18	0.05
338	600373	中文传媒	1,300	16,068.00	0.04
339	600690	海尔智家	536	16,021.04	0.04
340	000938	紫光股份	700	15,995.00	0.04
341	300968	格林精密	1,162	15,977.50	0.04
342	600126	杭钢股份	3,100	15,903.00	0.04
343	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.04
344	300034	钢研高纳	274	15,782.40	0.04
345	000333	美的集团	212	15,647.72	0.04
346	300896	爱美客	29	15,547.19	0.04
347	603882	金域医学	139	15,480.43	0.04
348	688116	天奈科技	103	15,376.87	0.04
349	601988	中国银行	5,037	15,362.85	0.04
350	300986	志特新材	237	15,170.37	0.04
351	002563	森马服饰	1,900	14,687.00	0.04
352	688139	海尔生物	159	14,440.38	0.04
353	600110	诺德股份	900	14,355.00	0.04
354	601328	交通银行	3,100	14,291.00	0.04
355	603889	新澳股份	2,300	14,237.00	0.04
356	603103	横店影视	1,076	14,213.96	0.04
357	600643	爱建集团	2,100	14,196.00	0.04
358	600315	上海家化	345	13,941.45	0.04
359	002010	传化智联	1,600	13,920.00	0.04
360	601600	中国铝业	2,282	13,897.38	0.04
361	300967	晓鸣股份	507	13,516.62	0.04
362	600598	北大荒	900	13,104.00	0.04
363	300498	温氏股份	679	13,077.54	0.04
364	600050	中国联通	3,296	12,953.28	0.04
365	601595	上海电影	1,148	12,421.36	0.03
366	601211	国泰君安	693	12,397.77	0.03
367	300348	长亮科技	765	11,987.55	0.03
368	600500	中化国际	1,400	11,984.00	0.03
369	300394	天孚通信	327	11,968.20	0.03
370	600577	精达股份	1,600	11,904.00	0.03
371	002087	新野纺织	3,300	11,880.00	0.03
372	300014	亿纬锂能	100	11,818.00	0.03
373	300993	玉马遮阳	410	11,771.10	0.03
374	300966	共同药业	286	11,731.72	0.03
375	002568	百润股份	196	11,726.68	0.03
376	603197	保隆科技	200	11,680.00	0.03
377	603127	昭衍新药	100	11,543.00	0.03
378	300357	我武生物	200	11,460.00	0.03

379	300962	中金辐照	576	11,422.08	0.03
380	601998	中信银行	2,449	11,314.38	0.03
381	002906	华阳集团	200	10,992.00	0.03
382	002460	赣锋锂业	76	10,856.60	0.03
383	300274	阳光电源	74	10,789.20	0.03
384	601599	浙文影业	3,187	10,676.45	0.03
385	300529	健帆生物	200	10,660.00	0.03
386	002230	科大讯飞	200	10,502.00	0.03
387	600018	上港集团	1,869	10,242.12	0.03
388	300661	圣邦股份	33	10,197.00	0.03
389	002895	川恒股份	400	9,876.00	0.03
390	300985	致远新能	201	9,853.02	0.03
391	300971	博亚精工	245	9,787.75	0.03
392	601658	邮储银行	1,900	9,690.00	0.03
393	688181	八亿时空	200	9,480.00	0.03
394	688363	华熙生物	59	9,162.70	0.03
395	603613	国联股份	85	9,137.50	0.03
396	002701	奥瑞金	1,300	9,100.00	0.03
397	300724	捷佳伟创	79	9,029.70	0.03
398	688368	晶丰明源	28	8,962.80	0.02
399	002029	七匹狼	1,400	8,652.00	0.02
400	300975	商络电子	492	8,575.56	0.02
401	001965	招商公路	1,100	8,437.00	0.02
402	300991	创益通	254	8,359.14	0.02
403	601598	中国外运	1,852	8,296.96	0.02
404	603733	仙鹤股份	200	8,162.00	0.02
405	600048	保利发展	518	8,096.34	0.02
406	600028	中国石化	1,893	8,007.39	0.02
407	300587	天铁股份	400	7,988.00	0.02
408	603806	福斯特	60	7,833.00	0.02
409	600926	杭州银行	598	7,666.36	0.02
410	601339	百隆东方	1,300	7,657.00	0.02
411	002142	宁波银行	200	7,656.00	0.02
412	603678	火炬电子	100	7,565.00	0.02
413	002027	分众传媒	920	7,534.80	0.02
414	688025	杰普特	97	7,473.85	0.02
415	600059	古越龙山	600	7,338.00	0.02
416	600009	上海机场	156	7,283.64	0.02
417	300456	赛微电子	296	7,269.76	0.02
418	688258	卓易信息	200	7,056.00	0.02
419	600155	华创阳安	706	7,031.76	0.02
420	603596	伯特利	100	6,960.00	0.02

421	300963	中洲特材	283	6,888.22	0.02
422	300972	万辰生物	430	6,815.50	0.02
423	002214	大立科技	341	6,731.34	0.02
424	300592	华凯创意	355	6,645.60	0.02
425	003816	中国广核	2,084	6,522.92	0.02
426	002698	博实股份	500	6,520.00	0.02
427	300737	科顺股份	400	6,500.00	0.02
428	000581	威孚高科	300	6,462.00	0.02
429	002743	富煌钢构	900	6,444.00	0.02
430	601288	农业银行	2,174	6,391.56	0.02
431	603128	华贸物流	462	6,320.16	0.02
432	300124	汇川技术	92	6,311.20	0.02
433	300041	回天新材	338	6,266.52	0.02
434	601866	中远海发	1,900	6,175.00	0.02
435	000001	平安银行	373	6,147.04	0.02
436	002078	太阳纸业	533	6,124.17	0.02
437	002327	富安娜	700	5,978.00	0.02
438	601138	工业富联	500	5,960.00	0.02
439	600398	海澜之家	914	5,858.74	0.02
440	601857	中国石油	1,180	5,793.80	0.02
441	603587	地素时尚	300	5,748.00	0.02
442	603160	汇顶科技	53	5,711.81	0.02
443	300433	蓝思科技	239	5,492.22	0.02
444	002714	牧原股份	100	5,336.00	0.01
445	002466	天齐锂业	46	4,922.00	0.01
446	601952	苏垦农发	400	4,764.00	0.01
447	601319	中国人保	963	4,526.10	0.01
448	600483	福能股份	269	4,379.32	0.01
449	688599	天合光能	55	4,339.50	0.01
450	300146	汤臣倍健	159	4,286.64	0.01
451	603566	普莱柯	193	4,265.30	0.01
452	000823	超声电子	300	4,086.00	0.01
453	600585	海螺水泥	100	4,030.00	0.01
454	600406	国电南瑞	100	4,003.00	0.01
455	688981	中芯国际	68	3,603.32	0.01
456	688188	柏楚电子	8	3,083.68	0.01

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	603806	福斯特	10,646,904.38	1.59

2	600809	山西汾酒	8,029,377.84	1.20
3	300496	中科创达	7,210,433.00	1.08
4	300750	宁德时代	7,207,495.00	1.08
5	300595	欧普康视	6,998,705.06	1.04
6	603267	鸿远电子	6,974,533.51	1.04
7	002064	华峰化学	6,871,874.00	1.03
8	603882	金域医学	6,660,663.20	0.99
9	002568	百润股份	6,586,290.14	0.98
10	601799	星宇股份	6,528,452.00	0.97
11	300463	迈克生物	6,508,411.68	0.97
12	300059	东方财富	6,200,285.88	0.93
13	603486	科沃斯	6,169,816.00	0.92
14	002139	拓邦股份	5,782,968.04	0.86
15	600438	通威股份	5,485,832.80	0.82
16	601919	中远海控	5,176,000.21	0.77
17	600309	万华化学	5,173,982.00	0.77
18	600426	华鲁恒升	5,145,004.24	0.77
19	601899	紫金矿业	5,112,962.00	0.76
20	300782	卓胜微	5,021,545.00	0.75

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	601888	中国中免	15,859,471.77	2.37
2	300750	宁德时代	12,176,360.13	1.82
3	600426	华鲁恒升	11,945,966.03	1.78
4	600519	贵州茅台	10,647,031.14	1.59
5	601012	隆基股份	10,461,629.79	1.56
6	600438	通威股份	10,202,273.67	1.52
7	300122	智飞生物	10,151,080.87	1.52
8	603806	福斯特	9,876,484.37	1.47
9	300595	欧普康视	9,659,806.87	1.44
10	000858	五粮液	9,268,424.74	1.38
11	300124	汇川技术	9,234,049.26	1.38
12	601318	中国平安	9,228,699.04	1.38
13	002078	太阳纸业	9,222,841.42	1.38
14	600309	万华化学	9,192,763.17	1.37
15	300059	东方财富	9,166,708.70	1.37
16	600809	山西汾酒	9,041,078.18	1.35
17	000568	泸州老窖	8,771,822.47	1.31
18	002821	凯莱英	8,326,846.85	1.24

19	603882	金域医学	8,193,204.91	1.22
20	000661	长春高新	8,011,824.61	1.20

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	1,249,814,380.90
卖出股票收入（成交）总额	1,829,521,318.77

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量（买/ 卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-1,017,160.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-640,480.00

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、

对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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	10,321.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	648.81
5	应收申购款	10,113.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,083.75

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份	持有人户	户均持有的	持有人结构
---	------	-------	-------

额 级 别	数（户）	基金份额	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	414	44,855.10	15,653,463.00	84.29	2,916,548.70	15.71
银 华 稳 健 增 利 灵 活 配 置 混 合 发 起 式 C	711	2,190.83	58,237.72	3.74	1,499,439.49	96.26
合 计	1,125	17,891.28	15,711,700.72	78.06	4,415,988.19	21.94

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所	银华稳健增利灵活配置混合发 起式 A	133,450.85	0.72

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 C	16,115.93	1.03
	合计	149,566.78	0.74

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	0
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	0~10
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,400.14	49.69	10,001,400.14	49.69	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	49.69	10,001,400.14	49.69	3 年

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳健增利灵活配置混合发起式	银华稳健增利灵活配置混合发起式
----	-----------------	-----------------

	A	C
基金合同生效日 (2017 年 12 月 15 日) 基金份额总额	13,175,905.27	1,086,315.48
本报告期期初基金份 额总额	475,911,840.40	879,061.09
本报告期基金总申购 份额	16,841,313.40	3,757,531.94
减: 本报告期基金总 赎回份额	474,183,142.10	3,078,915.82
本报告期基金拆分变 动份额(份额减少以 “-”填列)	-	-
本报告期末基金份 额总额	18,570,011.70	1,557,677.21

注: 总申购份额含转换入份额, 总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内, 无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内, 本基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

中国工商银行股份有限公司(以下简称“本公司”) 根据工作需要, 任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理, 全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

本基金管理人于 2021 年 1 月 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》, 本基金自 2021 年 1 月 29 日起在投资范围中增加存托凭证, 并在投资策略中增加存托凭证相关投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 45,000.00 元。该审计机构已为本基金连续提供了 4 年的服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富	5	3,073,717,117.29	100.00%	710,953.68	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	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	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	新增 1 个交 易单 元
安信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	新增 1 个交 易单 元
西南证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行其他证券投资。

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	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-1-20
2	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年第 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	2021-1-20
3	《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-1-29
4	《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	2021-1-29
5	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 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	2021-1-29
6	《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(2021 年 1 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-1-29
7	《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(2021 年 1 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-1-29
8	《银华基金管理股份有限公司关于基金经理暂停履行职务的公告》	本基金管理人网站, 三大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-3-5
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2021-3-29
10	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-3-29
11	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-4-20
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-4-21

13	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 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	2021-4-21
14	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金恢复大额申购(含定期定额投资及转换转入)业务的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-5-26
15	《银华基金管理股份有限公司关于增加平安银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-7-12
16	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在代销机构开通定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-7-16
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-7-19
18	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 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	2021-7-19
19	《银华基金管理股份有限公司关于调整银华旗下部分基金在代销机构费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-7-23
20	《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	2021-7-30
21	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-7-30
22	《银华基金管理股份有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告》	本基金管理人网站, 三大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-5
23	《银华基金管理股份有限公司关于中国国际金融股份有限公司、中国中金财富证券有限公司客户及业务整体迁移合并期间基金业务安排的提示性公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-9
24	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 证券时报, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-8-20
25	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2021-8-28
26	《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年中期报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2021-8-28

		网站	
27	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-10
28	《银华基金管理股份有限公司关于增加国泰君安证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-22
29	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金招募说明书更新(2021年第3号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-30
30	《银华稳健增利灵活配置混合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	2021-9-30
31	《银华基金管理股份有限公司关于银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-9-30
32	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021-10-26
33	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金 2021 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	2021-10-26
34	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-11-8
35	《银华基金管理股份有限公司关于银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站, 中国证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-1
36	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-1
37	《银华稳健增利灵活配置混合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	2021-12-2
38	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金招募说明书更新(2021年第4号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-2
39	《银华稳健增利灵活配置混合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	2021-12-24
40	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金招募说明书更新	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2021-12-24

	(2021 年第 5 号)》	网站	
41	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告北京》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021-12-24

§ 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	20210101-20210517	116,435,838.87	-	116,435,838.87	-	-
	2	20210101-20210517	115,953,826.64	-	115,953,826.64	-	-
	3	20210101-20210518	231,908,826.64	-	231,908,826.64	-	-
	4	20210518-202111231	10,001,400.14	-	-	10,001,400.14	49.69
	5	20210702-20210722	-	6,962,300.97	6,962,300.97	-	-
	6	202111224-202111231	-	5,652,062.86	-	5,652,062.86	28.08

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

1、本基金管理人于 2021 年 1 月 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 29 日起增加侧袋机制，在投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行了修订。

2、本基金管理人于 2021 年 12 月 24 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》，本基金自 2021 年 12 月 24 日起可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

§ 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

2022 年 3 月 29 日