

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券  
投资基金  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	24
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	68
12.3 查阅方式 .....	68

## § 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	20,735,611.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	005260	005261
报告期末下属分级基金的份额总额	19,422,572.23 份	1,313,039.03 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金灵活运用多种投资策略,在严格控制投资组合风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用定量和定性相结合的分析方法,结合对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素的定性分析,综合评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上,本基金将积极主动地对权益类资产、债券类资产和现金等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。本基金在股票投资过程中,运用量化模型和多种量化选股策略进行信息采集和处理,从而提高对于上市公司盈利变化、成长性变化、特殊事件等投资信息利用的效率,提高投资收益率。本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,动态调整组合久期和债券的结构,并通过自下而上精选债券,获取优化收益。本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%,权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%,每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010) 58163000	(010) 66105799
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95588
传真		(010) 58163027	(010) 66105798
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	陈四清

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
本期已实现收益	-4,535,441.92	-327,425.98
本期利润	-3,005,388.33	-256,030.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1550	-0.1813
本期加权平均净值利润率	-9.92%	-11.71%
本期基金份额净	-8.89%	-9.06%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	12,171,280.58	793,653.17
期末可供分配基金份额利润	0.6267	0.6044
期末基金资产净值	31,593,852.81	2,106,692.20
期末基金份额净值	1.6267	1.6044
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	62.67%	60.44%

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
过去一个月	9.46%	1.18%	4.29%	0.52%	5.17%	0.66%
过去三个月	4.75%	1.58%	2.73%	0.73%	2.02%	0.85%
过去六个月	-8.89%	1.50%	-4.95%	0.73%	-3.94%	0.77%
过去一年	-3.56%	1.32%	-5.04%	0.61%	1.48%	0.71%

过去三年	91.53%	1.31%	13.11%	0.62%	78.42%	0.69%
自基金合同生效起至今	62.67%	1.25%	11.95%	0.64%	50.72%	0.61%

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
过去一个月	9.43%	1.17%	4.29%	0.52%	5.14%	0.65%
过去三个月	4.65%	1.58%	2.73%	0.73%	1.92%	0.85%
过去六个月	-9.06%	1.50%	-4.95%	0.73%	-4.11%	0.77%
过去一年	-3.89%	1.32%	-5.04%	0.61%	1.15%	0.71%
过去三年	89.60%	1.31%	13.11%	0.62%	76.49%	0.69%
自基金合同生效起至今	60.44%	1.25%	11.95%	0.64%	48.49%	0.61%

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。

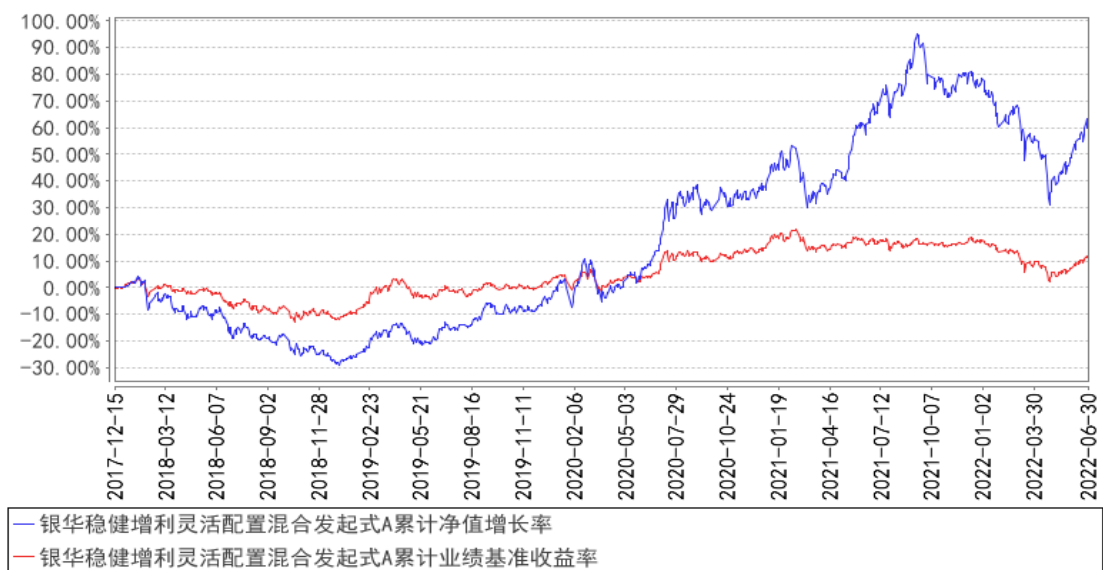
中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，其选样是所有流通的符合指数设计原则的记账式国债、央行票据和政策性银行债，是综合反映境内利率类债券整体价格走势情况的债券指数。

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。

## § 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 174 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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资

基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华华智三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医

药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金。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	-	13.5 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

				<p>式证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日至 2022 年 8 月 9 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 12 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 20 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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	-	12.5 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</p>

					<p>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。</p>
杨腾先生	本基金的基金经理	2021 年 11 月 29 日	-	9.5 年	<p>硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。2015 年 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</p>

					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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,本基金管理人所有投资组合不存在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。

#### 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 1.6267 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.89%；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 1.6044 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.06%；业绩比较基准收益率为-4.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中，新冠疫情在全球范围内由德尔塔时期转入奥密克戎时期。随着高传播性的新毒株从海外传入，以上海、北京为代表的多个国内城市与疫情进行了持续高强度作战。在整个上半年中，工业生产、餐饮服务、人员流动等社会活动都受到疫情的明显影响。疫情防控与经济修复的平衡点仍处于艰难的探索中。海外方面，以俄乌冲突为核心的地缘争端从突发转入逐步相持，以原油为代表的资源品价格持续提升，在进入二季度后呈现高位震荡，这一过程向全球范围扩散了通胀压力。在上述因素作用下，A 股市场在上半年中整体呈现调整。行业层面，煤炭、餐饮旅游、交通运输等行业收益领先，电子、传媒、计算机等行业表现落后。

展望下半年我们认为，疫情的防控节奏、药物的研发与扩产进程、海外地缘冲突的演化程度等因素，仍将是市场表现的潜在影响因素。某一个限制因素的持续放松或解除，都会使相应行业的公司经营得到潜在的机遇。在这一背景下，A 股市场仍将存在机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2021 年 5 月 18 日至 2022 年 6 月 30 日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,865,221.25	3,705,132.21
结算备付金		163,933.26	161,269.72
存出保证金		4,913.43	10,321.18
交易性金融资产	6.4.7.2	30,791,238.52	32,292,751.11
其中：股票投资		30,791,238.52	32,292,751.11
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,473.22	10,113.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	648.81
资产总计		33,831,779.68	36,180,236.79
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		18,489.02	180,843.74
应付管理人报酬		15,935.72	16,283.34
应付托管费		3,983.95	4,070.83
应付销售服务费		591.79	822.46
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	92,234.19	72,501.83
负债合计		131,234.67	274,522.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	20,735,611.26	20,127,688.91
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	12,964,933.75	15,778,025.68
净资产合计		33,700,545.01	35,905,714.59
负债和净资产总计		33,831,779.68	36,180,236.79

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 基金份额净值 1.6267 元，基金份额总额 19,422,572.23 份；银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额净值 1.6044

元，基金份额总额 1,313,039.03 份。银华稳健增利灵活配置混合发起式份额总额合计为 20,735,611.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,113,948.01	6,600,295.99
1. 利息收入		5,938.09	153,054.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,938.09	153,054.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,724,951.92	45,400,030.76
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,026,568.60	46,092,982.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-993,933.98
股利收益	6.4.7.19	301,616.68	300,982.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,601,448.77	-39,370,474.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	3,617.05	417,685.48
<b>减：二、营业总支出</b>		147,471.12	4,288,604.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	96,590.12	1,243,504.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,147.58	310,876.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,811.93	2,235.10

4. 投资顾问费			-
5. 利息支出			-
其中：卖出回购金融资产支出			-
6. 信用减值损失	6.4.7.22		-
7. 税金及附加			1,916.88
8. 其他费用	6.4.7.23	22,921.49	2,730,071.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,261,419.13	2,311,691.62
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,261,419.13	2,311,691.62
五、其他综合收益的税后净额			-
六、综合收益总额		-3,261,419.13	2,311,691.62

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	20,127,688.91	-	15,778,025.68	35,905,714.59
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	20,127,688.91	-	15,778,025.68	35,905,714.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	607,922.35	-	-2,813,091.93	-2,205,169.58

(一)、综合收益总额	-	-	-3,261,419.13	-3,261,419.13
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	607,922.35	-	448,327.20	1,056,249.55
其中:1.基金申购款	2,008,101.33	-	1,243,580.73	3,251,682.06
2.基金赎回款	-1,400,178.98	-	-795,253.53	-2,195,432.51
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	20,735,611.26	-	12,964,933.75	33,700,545.01
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	476,790,901.49	-	192,989,733.67	669,780,635.16
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	476,790,901.49	-	192,989,733.67	669,780,635.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-463,754,756.93	-	-184,058,959.81	-647,813,716.74
(一)、综合收益总额	-	-	2,311,691.62	2,311,691.62
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-463,754,756.93	-	-186,370,651.43	-650,125,408.36
其中:1.基金申购款	3,015,427.35	-	1,593,946.20	4,609,373.55
2.基金赎回款	-466,770,184.28	-	-187,964,597.63	-654,734,781.91
(三)、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	13,036,144.56	-	8,930,773.86	21,966,918.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]857号《关于准予银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于2017年11月13日至2017年12月8日向社会公开募集，基金合同于2017年12月15日生效，首次设立募集规模为13,175,905.27份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金根据所收取的认购费用、申购费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为A类和C类不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

本基金依法投资于国内发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准



上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具(含同业存单)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%, 权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%, 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为: 中证 800 指数收益率 $\times$ 50%+中国债券总指数收益率 $\times$ 50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(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》、《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 3 号《半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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外, 本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 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。

### 6.4.4.2 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

的有关过去事项、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。

#### 6.4.4.3 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) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

###### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,705,132.21 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 564.24 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,705,696.45 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 161,269.72 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 79.51 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 161,349.23 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,321.18 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 5.06 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,326.24 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 648.81 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 564.24 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 79.51 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 5.06 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

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

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

### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利

息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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

#### 6.4.6.3 企业所得税

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

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

#### 6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	2,865,221.25
等于：本金	2,864,958.76
加：应计利息	262.49
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	2,865,221.25

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	28,766,948.69	-	30,791,238.52	2,024,289.83
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	28,766,948.69	-	30,791,238.52	2,024,289.83

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 6.4.7.5 债权投资

注：无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

注：无。



## 6.4.7.7 其他权益工具投资

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	25.18
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	24,893.52
其中：交易所市场	24,893.52
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	67,315.49
合计	92,234.19

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,570,011.70	18,570,011.70
本期申购	1,406,611.23	1,406,611.23
本期赎回（以“-”号填列）	-554,050.70	-554,050.70
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	19,422,572.23	19,422,572.23

## 银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,557,677.21	1,557,677.21
本期申购	601,490.10	601,490.10
本期赎回（以“-”号填列）	-846,128.28	-846,128.28
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	1,313,039.03	1,313,039.03

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

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	18,207,252.51	-3,619,601.84	14,587,650.67
本期利润	-4,535,441.92	1,530,053.59	-3,005,388.33
本期基金份额交易产生的变动数	843,070.34	-254,052.10	589,018.24
其中：基金申购款	1,299,640.16	-399,962.80	899,677.36
基金赎回款	-456,569.82	145,910.70	-310,659.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,514,880.93	-2,343,600.35	12,171,280.58

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
本期期初	1,490,087.60	-299,712.59	1,190,375.01
本期利润	-327,425.98	71,395.18	-256,030.80
本期基金份额交易产生的变动数	-212,336.40	71,645.36	-140,691.04
其中：基金申购款	510,722.94	-166,819.57	343,903.37
基金赎回款	-723,059.34	238,464.93	-484,594.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	950,325.22	-156,672.05	793,653.17

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	4,642.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,240.13
其他	55.93
合计	5,938.09

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,026,568.60
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	-5,026,568.60

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	105,241,392.75
减：卖出股票成本总额	110,095,643.61
减：交易费用	172,317.74
买卖股票差价收入	-5,026,568.60

#### 6.4.7.15 债券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	301,616.68
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	301,616.68

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	1,601,448.77

股票投资	1,601,448.77
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	1,601,448.77

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	3,257.26
基金转换费收入	359.79
合计	3,617.05

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	606.00
合计	22,921.49

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	96,590.12	1,243,504.57
其中：支付销售机构的客户维护费	9,218.89	4,090.74

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,147.58	310,876.14

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置 混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置 混合发起式 C	合计
中国工商银行		205.49	205.49
银华基金管理股份有限公司		423.38	423.38
合计		628.87	628.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置 混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置 混合发起式 C	合计
中国工商银行		182.18	182.18
银华基金管理股份有限公司		110.64	110.64
合计		292.82	292.82

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
		银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

基金合同生效日(2017年12月15日)持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期初持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.49%	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日(2017年12月15日)持有的基金份额	10,001,400.14	-
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	84.56%	-

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。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,865,221.25	4,642.03	1,752,447.51	87,280.37

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

注：无。

##### 6.4.12.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：无。

##### 6.4.12.2 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

##### 6.4.13.2 信用风险

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



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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,865,221.25	-	-	-	2,865,221.25
结算备付金	163,933.26	-	-	-	163,933.26
存出保证金	4,913.43	-	-	-	4,913.43
交易性金融资产	-	-	-	30,791,238.52	30,791,238.52
应收申购款	-	-	-	6,473.22	6,473.22
资产总计	3,034,067.94	-	-	30,797,711.74	33,831,779.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	18,489.02	18,489.02
应付管理人报酬	-	-	-	15,935.72	15,935.72
应付托管费	-	-	-	3,983.95	3,983.95
应付销售服务费	-	-	-	591.79	591.79
其他负债	-	-	-	92,234.19	92,234.19
负债总计	-	-	-	131,234.67	131,234.67
利率敏感度缺口	3,034,067.94	-	-	30,666,477.07	33,700,545.01
上年度末 2021年12月31日					
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
应收申购款	-	-	-	10,113.76	10,113.76
其他资产	-	-	-	648.81	648.81
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
其他负债	-	-	-	72,501.83	72,501.83
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

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末（如有）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。

#### 6.4.13.4.2 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。

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	30,791,238.52	91.37	32,292,751.11	89.94
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	30,791,238.52	91.37	32,292,751.11	89.94

##### 6.4.13.4.2.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	2,967,154.27	3,119,446.82
	业绩比较基准下降 5%	-2,967,154.27	-3,119,446.82

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	30,791,238.52	32,263,835.91
第二层次	-	28,915.20
第三层次	-	-
合计	30,791,238.52	32,292,751.11

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、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。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	30,791,238.52	91.01
	其中：股票	30,791,238.52	91.01
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	3,029,154.51	8.95
8	其他各项资产	11,386.65	0.03
9	合计	33,831,779.68	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	353,273.84	1.05
B	采矿业	2,236,105.79	6.64
C	制造业	21,424,460.73	63.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	811,860.68	2.41
E	建筑业	336,956.05	1.00
F	批发和零售业	803,375.15	2.38
G	交通运输、仓储和邮政业	515,214.12	1.53

H	住宿和餐饮业	118,607.60	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,633,076.50	4.85
J	金融业	1,370,829.55	4.07
K	房地产业	283,448.92	0.84
L	租赁和商务服务业	364,663.91	1.08
M	科学研究和技术服务业	188,100.85	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	59,499.16	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	87,977.80	0.26
R	文化、体育和娱乐业	177,716.87	0.53
S	综合	26,071.00	0.08
	合计	30,791,238.52	91.37

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300363	博腾股份	5,452	425,201.48	1.26
2	601615	明阳智能	10,683	361,085.40	1.07
3	600519	贵州茅台	167	341,515.00	1.01
4	600153	建发股份	25,734	336,343.38	1.00
5	000960	锡业股份	19,869	333,203.13	0.99
6	601677	明泰铝业	13,643	324,703.40	0.96
7	300630	普利制药	9,219	324,047.85	0.96
8	688388	嘉元科技	3,627	307,823.49	0.91
9	002756	永兴材料	1,897	288,742.37	0.86
10	002920	德赛西威	1,873	277,204.00	0.82
11	600348	华阳股份	17,871	276,285.66	0.82
12	002439	启明星辰	13,500	269,055.00	0.80
13	300390	天华超净	2,873	251,100.20	0.75
14	000733	振华科技	1,797	244,338.09	0.73
15	603688	石英股份	1,800	238,698.00	0.71
16	300171	东富龙	7,000	237,370.00	0.70
17	600867	通化东宝	22,937	237,168.58	0.70
18	600745	闻泰科技	2,720	231,499.20	0.69
19	600188	兖矿能源	5,733	226,338.84	0.67
20	300474	景嘉微	3,290	225,003.10	0.67
21	002545	东方铁塔	19,596	223,002.48	0.66

22	600908	无锡银行	38,132	214,683.16	0.64
23	601198	东兴证券	23,666	210,627.40	0.62
24	002597	金禾实业	4,812	208,503.96	0.62
25	600885	宏发股份	4,760	199,206.00	0.59
26	300735	光弘科技	18,766	196,104.70	0.58
27	000825	太钢不锈	35,466	193,289.70	0.57
28	300482	万孚生物	4,721	192,191.91	0.57
29	000983	山西焦煤	14,290	191,343.10	0.57
30	002815	崇达技术	14,902	190,894.62	0.57
31	600863	内蒙华电	52,210	190,566.50	0.57
32	603456	九洲药业	3,682	190,359.40	0.56
33	300803	指南针	3,175	186,626.50	0.55
34	300432	富临精工	8,398	184,756.00	0.55
35	688521	芯原股份	3,626	179,124.40	0.53
36	600967	内蒙一机	19,639	179,107.68	0.53
37	600392	盛和资源	7,897	178,472.20	0.53
38	600256	广汇能源	16,709	176,112.86	0.52
39	601992	金隅集团	63,015	174,551.55	0.52
40	688198	佰仁医疗	1,429	174,223.68	0.52
41	000968	蓝焰控股	16,636	173,846.20	0.52
42	002643	万润股份	8,234	171,761.24	0.51
43	000729	燕京啤酒	17,535	169,388.10	0.50
44	000519	中兵红箭	5,749	167,583.35	0.50
45	300037	新宙邦	3,175	166,878.00	0.50
46	600305	恒顺醋业	12,602	162,565.80	0.48
47	002831	裕同科技	5,455	161,195.25	0.48
48	600862	中航高科	5,697	160,085.70	0.48
49	603187	海容冷链	4,379	160,052.45	0.47
50	600487	亨通光电	11,000	159,940.00	0.47
51	600985	淮北矿业	10,865	158,194.40	0.47
52	300118	东方日升	5,387	158,000.71	0.47
53	688099	晶晨股份	1,553	156,853.00	0.47
54	002091	江苏国泰	14,429	155,111.75	0.46
55	603267	鸿远电子	1,152	154,748.16	0.46
56	300633	开立医疗	5,134	154,174.02	0.46
57	600395	盘江股份	17,474	153,246.98	0.45
58	600483	福能股份	10,877	153,039.39	0.45
59	600929	雪天盐业	16,400	152,192.00	0.45
60	300170	汉得信息	16,756	150,971.56	0.45
61	601898	中煤能源	14,400	149,472.00	0.44
62	600285	羚锐制药	11,767	147,440.51	0.44
63	603348	文灿股份	2,734	146,542.40	0.43

64	002585	双星新材	8,066	145,913.94	0.43
65	601117	中国化学	15,320	144,161.20	0.43
66	002690	美亚光电	6,589	142,849.52	0.42
67	002036	联创电子	9,198	141,281.28	0.42
68	603379	三美股份	6,345	141,176.25	0.42
69	688037	芯源微	969	140,475.93	0.42
70	300699	光威复材	2,378	139,992.86	0.42
71	600461	洪城环境	17,200	139,148.00	0.41
72	300696	爱乐达	3,158	138,794.10	0.41
73	601877	正泰电器	3,837	137,287.86	0.41
74	000898	鞍钢股份	42,150	135,723.00	0.40
75	300750	宁德时代	249	132,966.00	0.39
76	600456	宝钛股份	2,177	129,313.80	0.38
77	002389	航天彩虹	7,000	128,520.00	0.38
78	000402	金融街	21,390	127,270.50	0.38
79	002738	中矿资源	1,360	125,949.60	0.37
80	300327	中颖电子	2,491	124,076.71	0.37
81	002240	盛新锂能	2,025	122,229.00	0.36
82	603613	国联股份	1,337	118,458.20	0.35
83	600160	巨化股份	8,760	115,194.00	0.34
84	600486	扬农化工	855	113,954.40	0.34
85	002299	圣农发展	5,900	113,162.00	0.34
86	600884	杉杉股份	3,800	112,936.00	0.34
87	601666	平煤股份	8,092	109,970.28	0.33
88	600754	锦江酒店	1,724	108,439.60	0.32
89	688200	华峰测控	304	108,345.60	0.32
90	300457	赢合科技	3,769	107,077.29	0.32
91	000762	西藏矿业	1,907	106,658.51	0.32
92	300776	帝尔激光	612	105,753.60	0.31
93	002867	周大生	6,455	100,246.15	0.30
94	600233	圆通速递	4,800	97,872.00	0.29
95	002019	亿帆医药	7,000	97,860.00	0.29
96	603979	金诚信	5,027	97,071.37	0.29
97	002594	比亚迪	284	94,711.16	0.28
98	603392	万泰生物	600	93,180.00	0.28
99	002839	张家港行	17,525	92,707.25	0.28
100	300409	道氏技术	3,563	92,566.74	0.27
101	601828	美凯龙	15,251	92,421.06	0.27
102	600063	皖维高新	12,144	92,051.52	0.27
103	002249	大洋电机	14,470	88,845.80	0.26
104	601118	海南橡胶	18,512	88,487.36	0.26
105	600426	华鲁恒升	3,000	87,600.00	0.26



106	600060	海信视像	6,941	86,762.50	0.26
107	300398	飞凯材料	3,784	86,502.24	0.26
108	300035	中科电气	3,073	85,890.35	0.25
109	601577	长沙银行	10,800	85,644.00	0.25
110	601808	中海油服	6,055	84,467.25	0.25
111	603986	兆易创新	588	83,619.48	0.25
112	601717	郑煤机	5,800	83,578.00	0.25
113	002215	诺普信	14,950	83,570.50	0.25
114	601689	拓普集团	1,219	83,416.17	0.25
115	000568	泸州老窖	338	83,330.52	0.25
116	300661	圣邦股份	450	81,909.00	0.24
117	300568	星源材质	2,745	79,714.80	0.24
118	000858	五粮液	391	78,954.63	0.23
119	000630	铜陵有色	24,213	78,934.38	0.23
120	601985	中国核电	11,300	77,518.00	0.23
121	301080	百普赛斯	462	77,103.18	0.23
122	002648	卫星化学	2,980	77,033.00	0.23
123	002156	通富微电	4,860	74,844.00	0.22
124	603920	世运电路	4,302	74,424.60	0.22
125	002601	龙佰集团	3,700	74,185.00	0.22
126	688005	容百科技	569	73,651.36	0.22
127	002258	利尔化学	3,107	73,387.34	0.22
128	300054	鼎龙股份	3,400	71,978.00	0.21
129	300244	迪安诊断	2,298	71,467.80	0.21
130	300829	金丹科技	2,197	71,226.74	0.21
131	300395	菲利华	1,562	70,290.00	0.21
132	600556	天下秀	8,500	69,955.00	0.21
133	002645	华宏科技	3,200	69,824.00	0.21
134	002982	湘佳股份	1,686	69,429.48	0.21
135	600563	法拉电子	337	69,138.92	0.21
136	688066	航天宏图	871	68,634.80	0.20
137	000598	兴蓉环境	13,315	68,039.65	0.20
138	600219	南山铝业	18,231	67,272.39	0.20
139	600739	辽宁成大	4,600	67,068.00	0.20
140	000039	中集集团	4,797	66,438.45	0.20
141	600155	华创阳安	7,815	66,271.20	0.20
142	600172	黄河旋风	7,554	65,870.88	0.20
143	002555	三七互娱	3,100	65,813.00	0.20
144	601088	中国神华	1,970	65,601.00	0.19
145	603605	珀莱雅	396	65,411.28	0.19
146	002497	雅化集团	1,998	65,234.70	0.19
147	603368	柳药集团	3,781	65,108.82	0.19

148	600711	盛屯矿业	8,365	64,912.40	0.19
149	300378	鼎捷软件	3,921	64,578.87	0.19
150	002610	爱康科技	15,500	64,170.00	0.19
151	300856	科思股份	1,476	64,028.88	0.19
152	000848	承德露露	6,606	63,946.08	0.19
153	603659	璞泰来	755	63,722.00	0.19
154	600050	中国联通	18,412	63,705.52	0.19
155	300769	德方纳米	153	62,528.04	0.19
156	600467	好当家	22,000	62,040.00	0.18
157	600873	梅花生物	5,487	61,893.36	0.18
158	603906	龙蟠科技	1,675	61,874.50	0.18
159	603816	顾家家居	1,087	61,556.81	0.18
160	688567	孚能科技	2,160	61,365.60	0.18
161	003019	宸展光电	2,415	60,954.60	0.18
162	600363	联创光电	2,700	60,642.00	0.18
163	000830	鲁西化工	3,496	60,445.84	0.18
164	002129	TCL 中环	1,026	60,421.14	0.18
165	002120	韵达股份	3,530	60,221.80	0.18
166	600008	首创环保	20,621	59,800.90	0.18
167	688019	安集科技	280	59,617.60	0.18
168	600507	方大特钢	8,500	59,415.00	0.18
169	002372	伟星新材	2,464	59,234.56	0.18
170	601899	紫金矿业	6,200	57,846.00	0.17
171	300674	宇信科技	3,634	56,981.12	0.17
172	603708	家家悦	4,000	56,960.00	0.17
173	300777	中简科技	1,172	56,490.40	0.17
174	002340	格林美	6,200	56,420.00	0.17
175	300529	健帆生物	1,100	55,979.00	0.17
176	600415	小商品城	10,000	55,700.00	0.17
177	688516	奥特维	208	55,525.60	0.16
178	603650	彤程新材	1,700	55,386.00	0.16
179	300481	濮阳惠成	2,353	55,295.50	0.16
180	300604	长川科技	1,223	55,218.45	0.16
181	603515	欧普照明	3,111	54,286.95	0.16
182	300394	天孚通信	2,000	54,140.00	0.16
183	605168	三人行	500	54,065.00	0.16
184	002567	唐人神	6,299	53,604.49	0.16
185	002008	大族激光	1,600	53,008.00	0.16
186	300618	寒锐钴业	900	52,128.00	0.15
187	603198	迎驾贡酒	800	52,112.00	0.15
188	600460	士兰微	1,000	52,000.00	0.15
189	688116	天奈科技	303	51,352.44	0.15

190	002174	游族网络	5,253	51,321.81	0.15
191	002539	云图控股	3,200	51,168.00	0.15
192	301177	迪阿股份	686	50,901.20	0.15
193	601668	中国建筑	9,500	50,540.00	0.15
194	000581	威孚高科	2,600	50,050.00	0.15
195	002078	太阳纸业	4,032	49,633.92	0.15
196	002466	天齐锂业	394	49,171.20	0.15
197	600970	中材国际	5,008	48,527.52	0.14
198	002541	鸿路钢构	1,450	48,430.00	0.14
199	002673	西部证券	7,400	48,396.00	0.14
200	002002	鸿达兴业	13,000	48,230.00	0.14
201	600919	江苏银行	6,700	47,704.00	0.14
202	002850	科达利	300	47,700.00	0.14
203	600705	中航产融	13,777	47,668.42	0.14
204	300685	艾德生物	1,478	47,296.00	0.14
205	600438	通威股份	787	47,109.82	0.14
206	603185	上机数控	300	46,797.00	0.14
207	600663	陆家嘴	4,500	46,620.00	0.14
208	600566	济川药业	1,699	46,144.84	0.14
209	603195	公牛集团	300	45,873.00	0.14
210	603707	健友股份	1,622	45,740.40	0.14
211	600499	科达制造	2,212	45,655.68	0.14
212	002745	木林森	4,668	45,606.36	0.14
213	601698	中国卫通	4,022	45,488.82	0.13
214	600642	申能股份	7,973	45,286.64	0.13
215	002946	新乳业	3,486	45,283.14	0.13
216	300601	康泰生物	992	44,818.56	0.13
217	600996	贵广网络	6,500	44,720.00	0.13
218	600999	招商证券	3,100	44,671.00	0.13
219	603529	爱玛科技	840	43,999.20	0.13
220	002832	比音勒芬	1,700	42,840.00	0.13
221	688036	传音控股	478	42,651.94	0.13
222	600389	江山股份	700	42,511.00	0.13
223	002739	万达电影	3,100	42,315.00	0.13
224	605123	派克新材	300	42,216.00	0.13
225	600765	中航重机	1,301	41,866.18	0.12
226	002304	洋河股份	227	41,575.05	0.12
227	601866	中远海发	13,814	41,442.00	0.12
228	601600	中国铝业	8,700	41,325.00	0.12
229	002230	科大讯飞	1,000	41,220.00	0.12
230	000656	金科股份	14,400	41,184.00	0.12
231	600699	均胜电子	2,600	40,846.00	0.12

232	600315	上海家化	950	40,612.50	0.12
233	000999	华润三九	900	40,500.00	0.12
234	300146	汤臣倍健	1,867	40,420.55	0.12
235	600057	厦门象屿	4,556	40,047.24	0.12
236	688330	宏力达	465	39,985.35	0.12
237	002459	晶澳科技	506	39,923.40	0.12
238	002507	涪陵榨菜	1,155	39,870.60	0.12
239	601222	林洋能源	4,700	39,245.00	0.12
240	600809	山西汾酒	120	38,976.00	0.12
241	601319	中国人保	7,600	38,456.00	0.11
242	600176	中国巨石	2,200	38,302.00	0.11
243	300319	麦捷科技	4,100	37,802.00	0.11
244	000685	中山公用	4,900	37,632.00	0.11
245	600039	四川路桥	3,561	37,497.33	0.11
246	601658	邮储银行	6,955	37,487.45	0.11
247	600104	上汽集团	2,100	37,401.00	0.11
248	600559	老白干酒	1,300	37,297.00	0.11
249	688033	天宜上佳	1,752	37,212.48	0.11
250	601872	招商轮船	6,400	36,864.00	0.11
251	600741	华域汽车	1,600	36,800.00	0.11
252	300121	阳谷华泰	3,400	36,482.00	0.11
253	000933	神火股份	2,779	36,349.32	0.11
254	688123	聚辰股份	341	36,323.32	0.11
255	300662	科锐国际	700	36,323.00	0.11
256	601919	中远海控	2,594	36,056.60	0.11
257	603098	森特股份	1,000	35,860.00	0.11
258	600522	中天科技	1,548	35,758.80	0.11
259	600835	上海机电	2,600	35,698.00	0.11
260	600325	华发股份	4,677	35,404.89	0.11
261	603103	横店影视	2,499	35,160.93	0.10
262	603128	华贸物流	3,500	35,105.00	0.10
263	002833	弘亚数控	2,100	35,028.00	0.10
264	600398	海澜之家	7,355	34,936.25	0.10
265	300332	天壕环境	3,083	34,529.60	0.10
266	002222	福晶科技	2,100	34,440.00	0.10
267	688215	瑞晟智能	1,126	34,264.18	0.10
268	300308	中际旭创	1,100	34,155.00	0.10
269	000810	创维数字	2,100	34,041.00	0.10
270	002895	川恒股份	1,000	33,810.00	0.10
271	002241	歌尔股份	1,000	33,600.00	0.10
272	601838	成都银行	2,000	33,160.00	0.10
273	688301	奕瑞科技	70	33,112.80	0.10

274	002266	浙富控股	6,892	33,012.68	0.10
275	000938	紫光股份	1,700	32,980.00	0.10
276	002075	沙钢股份	6,800	32,708.00	0.10
277	300709	精研科技	1,100	32,549.00	0.10
278	000988	华工科技	1,400	32,438.00	0.10
279	600587	新华医疗	1,600	32,400.00	0.10
280	603337	杰克股份	1,500	32,220.00	0.10
281	300416	苏试试验	1,300	31,954.00	0.09
282	000028	国药一致	1,062	31,636.98	0.09
283	002405	四维图新	2,094	31,556.58	0.09
284	300502	新易盛	1,200	31,440.00	0.09
285	002396	星网锐捷	1,387	31,401.68	0.09
286	688385	复旦微电	481	31,356.39	0.09
287	000786	北新建材	900	31,158.00	0.09
288	300369	绿盟科技	2,958	31,118.16	0.09
289	000050	深天马 A	3,100	30,907.00	0.09
290	600987	航民股份	5,746	30,626.18	0.09
291	300418	昆仑万维	1,900	30,400.00	0.09
292	000553	安道麦 A	2,500	30,275.00	0.09
293	600702	舍得酒业	148	30,190.52	0.09
294	601888	中国中免	127	29,582.11	0.09
295	002878	元隆雅图	1,500	28,950.00	0.09
296	600298	安琪酵母	589	28,713.75	0.09
297	002948	青岛银行	7,900	28,598.00	0.08
298	600528	中铁工业	3,500	28,175.00	0.08
299	002281	光迅科技	1,600	28,128.00	0.08
300	600118	中国卫星	1,400	28,112.00	0.08
301	600782	新钢股份	5,562	28,032.48	0.08
302	603987	康德莱	1,400	27,902.00	0.08
303	000811	冰轮环境	2,656	27,702.08	0.08
304	002216	三全食品	1,400	27,426.00	0.08
305	603713	密尔克卫	200	27,340.00	0.08
306	688707	振华新材	361	27,316.87	0.08
307	600887	伊利股份	700	27,265.00	0.08
308	603565	中谷物流	1,700	26,979.00	0.08
309	002409	雅克科技	486	26,977.86	0.08
310	603799	华友钴业	282	26,964.84	0.08
311	603259	药明康德	258	26,829.42	0.08
312	601298	青岛港	4,900	26,803.00	0.08
313	688199	久日新材	676	26,776.36	0.08
314	601998	中信银行	5,600	26,600.00	0.08
315	601699	潞安环能	1,792	26,199.04	0.08

316	000959	首钢股份	5,499	26,175.24	0.08
317	601328	交通银行	5,250	26,145.00	0.08
318	600673	东阳光	2,900	26,071.00	0.08
319	003035	南网能源	4,100	26,035.00	0.08
320	601233	桐昆股份	1,600	25,408.00	0.08
321	603678	火炬电子	542	25,371.02	0.08
322	000738	航发控制	900	25,290.00	0.08
323	601928	凤凰传媒	3,500	25,025.00	0.07
324	600028	中国石化	6,080	24,806.40	0.07
325	601989	中国重工	6,475	24,022.25	0.07
326	601225	陕西煤业	1,120	23,721.60	0.07
327	601288	农业银行	7,800	23,556.00	0.07
328	000877	天山股份	1,900	23,370.00	0.07
329	600787	中储股份	4,100	23,329.00	0.07
330	600372	中航电子	1,190	23,074.10	0.07
331	002511	中顺洁柔	1,800	22,536.00	0.07
332	603229	奥翔药业	591	22,493.46	0.07
333	688065	凯赛生物	200	22,360.00	0.07
334	601012	隆基绿能	329	21,921.27	0.07
335	600580	XD卧龙电	1,500	21,630.00	0.06
336	300763	锦浪科技	100	21,300.00	0.06
337	002557	洽洽食品	374	21,291.82	0.06
338	000778	新兴铸管	4,400	21,208.00	0.06
339	603867	新化股份	600	20,382.00	0.06
340	002572	索菲亚	719	19,772.50	0.06
341	002352	顺丰控股	353	19,700.93	0.06
342	688016	心脉医疗	98	19,091.38	0.06
343	300196	长海股份	1,000	18,890.00	0.06
344	601089	福元医药	895	18,839.75	0.06
345	600282	南钢股份	5,908	18,610.20	0.06
346	002460	赣锋锂业	125	18,587.50	0.06
347	603931	格林达	900	18,090.00	0.05
348	600373	中文传媒	1,806	18,041.94	0.05
349	603313	梦百合	1,500	18,000.00	0.05
350	688981	中芯国际	397	17,932.49	0.05
351	601939	建设银行	2,953	17,895.18	0.05
352	002984	森麒麟	567	17,639.37	0.05
353	300681	英搏尔	300	17,331.00	0.05
354	603063	禾望电气	450	17,302.50	0.05
355	600428	中远海特	3,621	17,235.96	0.05
356	000892	欢瑞世纪	4,500	16,920.00	0.05
357	603882	金域医学	200	16,510.00	0.05

358	002759	天际股份	600	16,308.00	0.05
359	002438	江苏神通	1,100	16,225.00	0.05
360	002385	大北农	2,000	15,620.00	0.05
361	600435	北方导航	1,800	15,516.00	0.05
362	600378	昊华科技	399	15,369.48	0.05
363	002865	钧达股份	161	15,352.96	0.05
364	000401	冀东水泥	1,446	15,211.92	0.05
365	601598	中国外运	3,897	15,120.36	0.04
366	002841	视源股份	200	15,064.00	0.04
367	600138	中青旅	1,150	14,823.50	0.04
368	600498	烽火通信	1,023	14,813.04	0.04
369	002320	海峡股份	2,600	14,794.00	0.04
370	601021	春秋航空	252	14,704.20	0.04
371	600390	五矿资本	3,000	14,670.00	0.04
372	600583	海油工程	3,523	14,620.45	0.04
373	688139	海尔生物	200	14,566.00	0.04
374	688777	中控技术	200	14,552.00	0.04
375	002080	中材科技	526	14,465.00	0.04
376	600977	中国电影	1,240	14,260.00	0.04
377	300470	中密控股	404	14,257.16	0.04
378	688518	联赢激光	412	14,003.88	0.04
379	300133	华策影视	2,800	13,944.00	0.04
380	300073	当升科技	154	13,912.36	0.04
381	603328	依顿电子	2,168	13,766.80	0.04
382	688107	安路科技	200	13,740.00	0.04
383	002126	银轮股份	1,196	13,694.20	0.04
384	002906	华阳集团	300	13,593.00	0.04
385	300316	晶盛机电	200	13,518.00	0.04
386	000625	长安汽车	780	13,509.60	0.04
387	000728	国元证券	2,100	13,062.00	0.04
388	603596	伯特利	161	12,908.98	0.04
389	300894	火星人	343	12,824.77	0.04
390	603300	华铁应急	1,600	12,752.00	0.04
391	002472	双环传动	400	12,736.00	0.04
392	000069	华侨城 A	1,953	12,674.97	0.04
393	600597	光明乳业	1,000	12,630.00	0.04
394	300476	胜宏科技	683	12,539.88	0.04
395	688012	中微公司	107	12,492.25	0.04
396	002371	北方华创	45	12,470.40	0.04
397	300783	三只松鼠	496	12,424.80	0.04
398	300755	华致酒行	283	12,409.55	0.04
399	688188	柏楚电子	56	12,322.24	0.04

400	300487	蓝晓科技	200	12,200.00	0.04
401	603486	科沃斯	100	12,189.00	0.04
402	002312	川发龙蟒	700	12,082.00	0.04
403	601949	中国出版	2,500	12,050.00	0.04
404	300458	全志科技	399	12,005.91	0.04
405	300761	立华股份	300	11,925.00	0.04
406	300455	康拓红外	1,386	11,878.02	0.04
407	002933	新兴装备	388	11,748.64	0.03
408	000090	天健集团	1,700	11,713.00	0.03
409	300347	泰格医药	100	11,445.00	0.03
410	300095	华伍股份	849	11,138.88	0.03
411	300122	智飞生物	100	11,101.00	0.03
412	300748	金力永磁	300	11,040.00	0.03
413	300348	长亮科技	1,101	10,635.66	0.03
414	000977	浪潮信息	400	10,592.00	0.03
415	603060	国检集团	877	10,567.85	0.03
416	000423	东阿阿胶	285	10,530.75	0.03
417	600968	海油发展	4,049	10,446.42	0.03
418	603588	高能环境	900	10,377.00	0.03
419	603733	仙鹤股份	389	10,347.40	0.03
420	600585	海螺水泥	293	10,337.04	0.03
421	300447	全信股份	500	10,185.00	0.03
422	600258	首旅酒店	410	10,168.00	0.03
423	000672	上峰水泥	644	10,162.32	0.03
424	603938	三孚股份	200	9,886.00	0.03
425	000799	酒鬼酒	53	9,847.93	0.03
426	603993	洛阳钼业	1,700	9,741.00	0.03
427	603668	天马科技	473	9,691.77	0.03
428	600928	西安银行	2,639	9,685.13	0.03
429	002384	东山精密	420	9,630.60	0.03
430	603908	牧高笛	100	9,515.00	0.03
431	002436	兴森科技	843	9,500.61	0.03
432	300382	斯莱克	600	9,402.00	0.03
433	600882	妙可蓝多	200	9,360.00	0.03
434	601318	中国平安	200	9,338.00	0.03
435	300393	中来股份	549	9,333.00	0.03
436	600184	光电股份	671	9,286.64	0.03
437	300861	美畅股份	100	9,269.00	0.03
438	688295	中复神鹰	246	9,222.54	0.03
439	688110	东芯股份	243	9,214.56	0.03
440	601238	广汽集团	600	9,144.00	0.03
441	002001	新和成	400	9,124.00	0.03



442	002807	江阴银行	2,000	9,060.00	0.03
443	300226	上海钢联	400	9,060.00	0.03
444	000792	盐湖股份	300	8,988.00	0.03
445	600141	兴发集团	200	8,798.00	0.03
446	600177	雅戈尔	1,313	8,705.19	0.03
447	601669	XD 中国电	1,100	8,657.00	0.03
448	002244	滨江集团	1,000	8,650.00	0.03
449	000552	靖远煤电	2,000	8,620.00	0.03
450	300349	金卡智能	878	8,551.72	0.03
451	603818	曲美家居	900	8,550.00	0.03
452	603359	东珠生态	700	8,456.00	0.03
453	603599	广信股份	300	8,445.00	0.03
454	002683	广东宏大	300	8,349.00	0.02
455	300571	平治信息	200	8,260.00	0.02
456	300087	荃银高科	500	8,230.00	0.02
457	688575	亚辉龙	392	8,200.64	0.02
458	300559	佳发教育	831	8,177.04	0.02
459	603323	苏农银行	1,600	8,160.00	0.02
460	601933	永辉超市	1,872	8,012.16	0.02
461	600079	XD 人福医	500	8,000.00	0.02
462	603773	沃格光电	500	8,000.00	0.02
463	300033	同花顺	83	7,980.45	0.02
464	002672	东江环保	1,288	7,972.72	0.02
465	601156	东航物流	400	7,920.00	0.02
466	300773	拉卡拉	410	7,814.60	0.02
467	000063	中兴通讯	300	7,659.00	0.02
468	601555	东吴证券	1,100	7,623.00	0.02
469	601865	福莱特	200	7,620.00	0.02
470	600048	保利发展	436	7,612.56	0.02
471	300682	朗新科技	300	7,557.00	0.02
472	688001	华兴源创	276	7,512.72	0.02
473	603365	水星家纺	500	7,490.00	0.02
474	600567	山鹰国际	2,700	7,479.00	0.02
475	600019	宝钢股份	1,235	7,434.70	0.02
476	000823	超声电子	719	7,434.46	0.02
477	601857	中国石油	1,400	7,420.00	0.02
478	600729	重庆百货	343	7,398.51	0.02
479	000301	东方盛虹	429	7,254.39	0.02
480	603387	基蛋生物	500	7,130.00	0.02
481	002926	华西证券	900	7,056.00	0.02
482	002049	紫光国微	37	7,019.64	0.02
483	003012	东鹏控股	800	6,992.00	0.02

484	600938	中国海油	400	6,980.00	0.02
485	600966	博汇纸业	900	6,966.00	0.02
486	002465	海格通信	743	6,753.87	0.02
487	605358	立昂微	100	6,738.00	0.02
488	600760	中航沈飞	111	6,709.95	0.02
489	603568	伟明环保	196	6,540.52	0.02
490	002003	伟星股份	677	6,431.50	0.02
491	603501	韦尔股份	37	6,402.11	0.02
492	000539	粤电力 A	1,500	6,300.00	0.02
493	000708	中信特钢	309	6,226.35	0.02
494	300613	富瀚微	73	6,190.40	0.02
495	601882	海天精工	300	6,183.00	0.02
496	001268	联合精密	218	6,042.96	0.02
497	000627	天茂集团	1,701	5,800.41	0.02
498	605399	晨光新材	130	5,531.50	0.02
499	600690	海尔智家	200	5,492.00	0.02
500	002271	东方雨虹	100	5,147.00	0.02
501	000902	新洋丰	300	5,067.00	0.02
502	601018	宁波港	1,291	5,034.90	0.01
503	600029	南方航空	661	4,831.91	0.01
504	300384	三联虹普	224	4,166.40	0.01
505	600383	金地集团	300	4,032.00	0.01
506	600018	上港集团	662	3,859.46	0.01
507	600339	中油工程	1,327	3,835.03	0.01
508	002701	奥瑞金	600	3,120.00	0.01
509	000001	平安银行	100	1,498.00	0.00
510	300815	玉禾田	64	1,112.96	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600282	南钢股份	560,092.00	1.56
2	600519	贵州茅台	532,292.00	1.48
3	601898	中煤能源	513,112.00	1.43
4	300363	博腾股份	513,036.00	1.43
5	601198	东兴证券	503,066.00	1.40
6	600487	亨通光电	498,534.00	1.39
7	600862	中航高科	484,975.00	1.35
8	002120	韵达股份	484,563.00	1.35
9	688388	嘉元科技	483,501.51	1.35
10	600170	上海建工	472,429.00	1.32

11	600153	建发股份	460,312.00	1.28
12	600867	通化东宝	452,600.00	1.26
13	300638	广和通	452,476.00	1.26
14	688005	容百科技	447,237.87	1.25
15	002597	金禾实业	436,574.00	1.22
16	002484	江海股份	433,370.00	1.21
17	600348	华阳股份	422,092.00	1.18
18	600188	兖矿能源	408,515.00	1.14
19	600566	济川药业	405,783.00	1.13
20	600023	浙能电力	402,883.00	1.12

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	784,500.43	2.18
2	600862	中航高科	666,200.87	1.86
3	600765	中航重机	637,017.42	1.77
4	600282	南钢股份	634,110.35	1.77
5	002120	韵达股份	552,160.71	1.54
6	601898	中煤能源	534,823.40	1.49
7	600008	首创环保	521,381.30	1.45
8	688005	容百科技	520,595.18	1.45
9	600297	广汇汽车	472,333.04	1.32
10	300638	广和通	458,983.68	1.28
11	600057	厦门象屿	458,418.76	1.28
12	601618	中国中冶	448,275.24	1.25
13	600170	上海建工	444,333.39	1.24
14	002484	江海股份	432,945.58	1.21
15	002597	金禾实业	421,567.91	1.17
16	600623	华谊集团	417,614.29	1.16
17	000709	河钢股份	405,966.68	1.13
18	600141	兴发集团	403,867.85	1.12
19	600487	亨通光电	400,032.70	1.11
20	600884	杉杉股份	394,153.87	1.10

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	106,992,682.25
卖出股票收入（成交）总额	105,241,392.75

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）

填列，不考虑交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

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

##### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,913.43
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,473.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	11,386.65
---	----	-----------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	356	54,557.79	15,653,463.00	80.59	3,769,109.23	19.41
银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	811	1,619.04	-	-	1,313,039.03	100.00
合计	1,167	17,768.30	15,653,463.00	75.49	5,082,148.26	24.51

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	133,892.18	0.69
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	20,067.73	1.53
	合计	153,959.91	0.74

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	-
	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	0~10
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	0
	合计	0~10

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,400.14	48.23	10,001,400.14	48.23	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	48.23	10,001,400.14	48.23	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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017年12月15日）基金份额总额	13,175,905.27	1,086,315.48
本报告期期初基金份额总额	18,570,011.70	1,557,677.21

本报告期基金总申购份额	1,406,611.23	601,490.10
减：本报告期基金总赎回份额	554,050.70	846,128.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	19,422,572.23	1,313,039.03

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

2022年3月1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，张轶先生自2022年2月28日起担任本基金管理人首席信息官职务。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方财富	3	212,163,780.58	100.00	49,071.23	100.00	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
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	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
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	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末运用交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海万得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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022年01月04日
2	《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 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	2022年01月21日
3	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022年01月21日
4	《银华基金管理股份有限公司关于增加东方财富证券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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022年03月14日
5	《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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022年03月29日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2022年03月29日
7	《银华基金管理股份有限公司关于增加中信建投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, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报	2022年04月19日
8	《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 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	2022年04月20日

9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 04 月 20 日
10	《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, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2022 年 05 月 19 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 中国证券报, 证券时报, 证券日报	2022 年 06 月 08 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220630	10,001,400.14	0.00	0.00	10,001,400.14	48.23
	2	20220101-20220630	5,652,062.86	0.00	0.00	5,652,062.86	27.26

#### 产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申

购或转换转入申请可能被确认失败。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2022 年 8 月 29 日