

银华多元回报一年持有期混合型证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>17</b>
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	银华多元回报一年持有期混合
基金主代码	012434
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 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	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,164,970,992.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在努力控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过多元化的配置策略，积极优选全市场的投资机会，整体性布局于具有核心竞争力及比较优势的行业和公司，严格控制投资组合风险的同时，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金从大类资产比较研究的立场出发，在综合考量中国宏观经济运行态势、国内股票市场的估值水平、国内债券市场的收益率期限结构、CPI 与 PPI 变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素的基础上，分别评价各类资产的风险收益水平，进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、期货、债券、货币市场工具等金融工具上的投资比例，并进行动态调整，力求实现基金资产的长期稳定增值，提高基金资产在不同市场状况下的整体收益水平。本基金在股票投资方面将坚持价值投资理念，并尊重市场的中短期变化，在深入研究宏观经济环境、经济政策、行业前景、上市公司基本面等因素的基础上，充分考虑投资标的的基本面趋势、估值、预期差等情况，采取多策略管理策略。</p> <p>本基金坚持多策略的投资组合构建方法，亦即根据市场环境的动态调整，不断评估经济和市场的变化，并持续更新和完善投资框架，以适应不同的市场环境变化，而不是墨守成规、无视市场的变化。</p> <p>在多策略下，本基金的投资组合可以分为以下四个部分：</p> <p>(1) 低估值组合：从长期来看，低估值股票能够提供安全边际，面临各种有利因素，存在估值抬升的空间。</p> <p>(2) 高成长组合：当前中国经济处于转型阶段，经济结构正在发生快速变化，一些新兴行业高速增长，例如，伴随着（移动）互联网在各个垂直细分行业的渗透，带来了移动营销、移动医疗、智能家居、智能社区等领域的变革。</p> <p>(3) 预期差组合：A 股市场具有信息传递速度快、市场盲点少的特点，因此要想取得超额收益，需要广泛研究，寻找暂时被市场冷落的机会，提前预判、抢前半步。</p> <p>(4) 主题组合：进行主题投资的本质原因在于宏观政策、行业</p>

	<p>政策对资本市场存在着显著影响。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合指数（全价）收益率*20%
风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金可投资香港联合交易所上市的股票，如投资将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。</p>

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	李帅帅
	联系电话	(010)58163000	0755-25878287
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95511-3
传真		(010)58163027	0755-82080387
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		100738	518001
法定代表人		王珠林	谢永林

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<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(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	-23,401,703.65
本期利润	-70,994,725.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0294
本期加权平均净值利润率	-3.69%
本期基金份额净值增长率	-4.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-536,245,105.87
期末可供分配基金份额利润	-0.2477
期末基金资产净值	1,628,725,886.83
期末基金份额净值	0.7523
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-24.77%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.33%	1.04%	1.77%	0.71%	-1.44%	0.33%
过去三个月	-6.69%	0.86%	-3.13%	0.67%	-3.56%	0.19%
过去六个月	-4.32%	0.85%	-0.36%	0.68%	-3.96%	0.17%
过去一年	-15.44%	0.96%	-9.50%	0.82%	-5.94%	0.14%
自基金合同生效起至今	-24.77%	0.96%	-19.30%	0.92%	-5.47%	0.04%

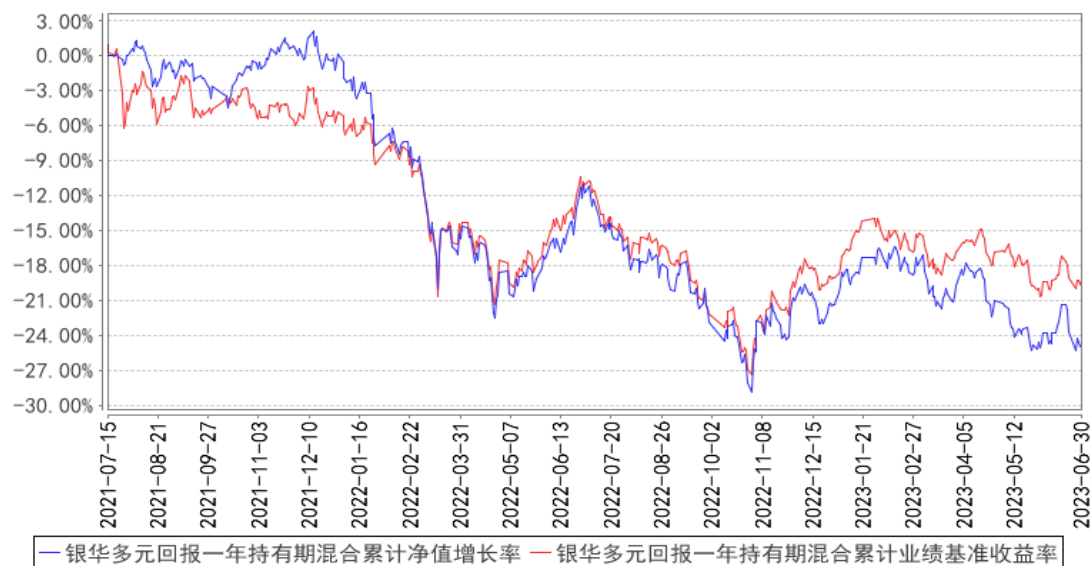
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率\*20%+中债综合指数（全价）收益率\*20%

沪深 300 指数市值覆盖率高，样本股当中集中了市场中大量优质股票，流动性好，可以成为反映沪深两个市场整体走势的“晴雨表”，适合作为本基金 A 股投资的比较基准。中证港股通综合

指数选取符合港股通资格的普通股作为样本股，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势，适合作为本基金港股通标的股票投资部分的业绩比较基准。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，能够综合反映债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一；该指数样本覆盖广泛，编制方法合理，样本券包括记账式国债、央行票据、短期融资券、中期票据、政策性银行债券、商业银行债券、证券公司短期融资券、证券公司债、地方企业债、国际机构债券、非银行金融机构债、中央企业债等债券。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现；指数公布透明、公开，具有较好的市场接受度。该指数适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

### 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

银华多元回报一年持有期混合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：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%（投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%）。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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



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

截至 2023 年 6 月 30 日,本基金管理人管理 188 只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华一道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投资基金(LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发

起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金 (QDII)、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证

券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华华智三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金 (QDII)、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA

指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾鹏先生	本基金的基金经理	2021 年 7 月 15 日	-	14.5 年	硕士学位，2008 年 3 月至 2011 年 3 月期间任职于银华基金管理有限公司，担任行业研究员职务；2011 年 4 月至 2012 年 3 月期间任职于瑞银证券有限责任公司，担任行业研究组长；2012 年 4 月至 2014 年 6 月期间任职于建信基金管理有限公司，担任基金经理助理。2014 年 6 月起任职于银华基金管理有限公司，自 2014 年 8 月 27 日至 2017 年 8 月 7 日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自 2014 年 8 月 27 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2014 年 9 月 12 日至 2020 年 3 月 16 日兼任银华保本增值证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 17 日至 2020 年 5 月 21 日兼任银华增值证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月 31 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 1 日至 2017 年 7 月 5 日兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 5 月 19 日起兼任银华多元视野

					灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 8 月 8 日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 14 日起兼任银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 1 月 29 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 6 日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 2 月 19 日起兼任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 10 日起兼任银华多元机遇混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 8 日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 15 日起兼任银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
杨沐阳先生	本基金的基金经理助理	2021 年 7 月 19 日	-	6 年	硕士学位。曾就职于中国工商银行股份有限公司，2017 年 10 月加入银华基金，历任投资管理三部固收研究部宏观利率研究员，现任固定收益及资产配置部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、张雨先生自 2023 年 7 月 16 日起开始担任本基金基金经理助理。

#### 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、《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 5 次，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在过去的 23 年上半年，资本市场呈现出结构剧烈分化、波动较大的特征，总体表现弱于年初的预期。我们在去年底，展望 23 年市场走势时，认为影响市场的宏观变量，主要由两个，一个是中国经济的走势，一个是美国通胀的变化，这两个因素的结合，可以带来市场不同的情景。上半年以来，国内经济总体在复苏的进程中，不过比年初的预期要弱一些；美国的通胀总体在回落的趋势里，不过回落的速度和幅度，也比预期要慢一些。因此，上半年，纯债的走势强于预期，股票的走势弱于预期。

消费领域的基本面，今年表现出比较大的分化；消费股的股价，上半年总体表现的比较差。22 年底、23 年初的时候，很多投资者（包括我们自己），都预测今年某些消费领域会出现强势修复，再考虑到供应端在过去两年连续收缩，这些领域的价格可能会出现大幅上涨，比如说各种线下服务的价格；投资者甚至担心过 23 年下半年会出现通胀。回过头来看，今年消费行业确实在复苏，不过总体的力度要弱于年初的预期。我们始终在关注消费领域的投资机会，今年以来，我们在挖掘消费股时，比较关注的是公司当期业绩增长和估值的匹配度，适当规避了机构抱团的公司。在当期阶段，投资者对经济和消费的预期比较悲观，消费股的估值也降低了不少，板块的性价比是提高的。不过，我们还是坚持自下而上的方法，不为了配置而投资，努力去选择业绩可能会超预期，或者估值已经足够低，或者是极少数未来能成长为大公司的消费股进行投资。

成长领域也是上半年分化特别大的方向。我们在 22 年底的年度总结和展望中，表达了一个观点，今年成长的主线大概率在 TMT 方向，新能源 23 年的投资难度会比较大。当时的考虑，是基于股价位置、产业生命周期的位置。23 年以来，AI 产业突飞猛进，带动相关公司的预期和股价出现了大幅上行。其实不光 AI 产业，包括自动驾驶、机器人、氢能、PET 铜箔、卫星互联网、MR 等领

域都有不错的股价表现。在其他行业业绩增长不是很靓丽的背景下，投资者将关注点放到了这些可能有巨大空间的新兴产业方面。某种程度上，上半年的 A 股市场，有一定主题投资的特征。当然，在这些产业中，AI 是当下和未来两年最为重要的产业趋势，对我们的社会生活和投资都会带来巨大的影响。当前阶段，我们还站在这场变革的门口，跟历史上重大产业革命一样，未来的机会巨大，陷阱也巨大。

上半年，AI 产业的股价表现，主要围绕海外逻辑展开，包括光模块、海外应用的公司涨幅很大，大幅领先市场。下半年，我们预期国内的产业推进，有可能会加速，进而推动国内应用等公司的股价有较好表现。在往后看，如果国内外应用推进顺利，一段时间以后，可能会带动硬件端出现创新浪潮，进而带动电子产业景气度上行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.7523 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.32%，业绩比较基准收益率为-0.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最近，有好朋友和前辈跟我说了一个提法——不要基于牛市的期待去做投资，听完很受启发。首先要声明，这并不是说，未来一段时间不会有牛市，我们对资本市场的前景是充满信心的。这段话，实在是经过资本市场长期捶打之后的经验之谈。我在做研究员时，最开始做的是宏观策略研究，为了判断大盘，反复总结，不断更新分析框架。做了这么多年投资之后，回头看看，预测市场走向的种种努力，很多时候看起来都是可笑的。远的自不必说，翻翻年初的预测报告，上半年市场的走势，能大部分流行的预测，都存在比较大的偏差。关于市场总体，相对比较靠谱的分析，主要的功能是，告诉投资者，目前大盘是在比较贵的位置，还是比较便宜的位置。

不基于牛市的期待去投资，就是说，要把赚钱的主要期待，放在以合理或者低估的价格买到优质的企业上面。具体来说，重要的东西有两个，一个是企业创造现金回报的能力，一个是比较便宜的买入价格。这确实比较契合今年上半年的市场风格，低估值、高分红股票表现比较好。这个现象，至少可以找到两个原因来解释。第一方面，低估值高分红标的行情，拉动了相关公司估值的修复。第二方面，今年经济呈现弱复苏的态势，自上而下的看，上市公司业绩不突出，而流动性比较宽松，资金寻找有确定性收益的资产，在一定程度上形成了“资产荒”的现象，低估值、高分红股票类债属性被挖掘。

我们把上述这种股票分成两大类，第一类是贝塔型的，随着整个低估值板块的上涨，估值也跟着提升。第二类是阿尔法型的，除了具备估值低、分红好等因素之外，经营上要有比较好的护城河，业绩的稳定性强。护城河有很多种，一种简单直观的护城河，就是拥有得天独厚的资源，

通俗的说就是可以躺赢，经营上不用去跟竞争对手卷。比如说，公司有一座资源丰富的水电站、成本低的油田、客流稳定的铁路线。根据公开的气象资料，今年上半年，国内降雨偏少，水电来水不太好。对于水电公司来说，这会影响它一到两个季度的业绩。但是在它足够长的经营周期里面，一个季度业绩稍微少点，对公司的价值，影响是很小的，说不定哪个季度来水又很好，当期业绩又超了预期。

长期以来，我们嘴巴上明白这些道理，不过持仓这类高护城河公司并不多。在经济高增速阶段，比较容易找到业绩前景迷人的投资标的，这类公司看起来有些鸡肋。随着经济潜在增速的下降，高增长故事开始变的比较稀缺，永续增长的公司就变得很珍贵了。特别是，如果因为短期因素的影响，导致这些公司股价明显低于其长期价值时，能以打折的价格买到一个高护城河企业，这个时候是不能错过的。今年以来，我们已经开始在这方面加大研究和关注的力度，未来几年应该也会是我们重要的工作。

站在这个时点，我们对三季度或者下半年的市场，总的态度是“风险偏好的温和修复”。当然，首先我们得承认，预测市场的行为，事后看往往都是靠碰运气。我们之所以做出这个判断，主要是三个理由。首先，投资者的预期非常悲观，市场的估值到了历史比较极端便宜的位置。最近很多人都在研究日本的历史，担心中国经济会不会出现类似的资产负债表衰退、人口老化带来的一系列问题。这些担心在短期的股价中已经有比较多的反应。第二，二季度经济走势，已经引起管理层的关注，一些政策也做了结构性调整，随着时间推移，效果也会慢慢显现；如果经济走势仍然不及预期，政策还有可能进一步做相应调整。第三，金融市场流动性仍然是充裕的，资产荒的现象继续存在，在债券收益率下行至低位后，股票市场至少有一部分公司的性价比是在提升的。经过上半年的震荡之后，祝愿我们的客户，下半年能获得一个相对满意的投资回报。

#### 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历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。



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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,127,987.91	6,959,554.74
结算备付金		6,506,585.04	8,925,022.34
存出保证金		780,986.84	1,272,989.12
交易性金融资产	6.4.7.2	1,603,770,277.79	1,898,789,464.41

其中：股票投资		1,495,717,234.37	1,779,461,769.63
基金投资		-	-
债券投资		108,053,043.42	119,327,694.78
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	-11,735.83	113,773,518.16
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		35,077,504.09	16,091,501.17
应收股利		2,824,527.67	-
应收申购款		26,929.78	24,879.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,653,103,063.29	2,045,836,928.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		14,621,679.45	7,412,894.61
应付赎回款		5,406,402.41	1,339,594.43
应付管理人报酬		2,081,569.50	2,609,211.20
应付托管费		346,928.23	434,868.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	243.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,920,596.87	2,615,955.10
负债合计		24,377,176.46	14,412,767.39
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,164,970,992.70	2,583,454,607.59
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-536,245,105.87	-552,030,446.02
净资产合计		1,628,725,886.83	2,031,424,161.57
负债和净资产总计		1,653,103,063.29	2,045,836,928.96

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7523 元，基金份额总额 2,164,970,992.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-54,146,233.01	-314,383,674.27
1. 利息收入		573,031.56	4,916,010.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	111,485.16	503,014.35
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		461,546.40	4,412,996.47
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,126,242.41	-374,816,680.72
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-18,614,207.43	-390,264,662.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	302,994.71	4,167,297.45
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	11,184,970.31	11,280,684.59
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	-47,593,022.16	55,516,995.63
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		16,848,492.80	23,012,214.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,327,818.74	19,620,345.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,387,969.78	3,270,057.66

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		33.47	406.26
8. 其他费用	6.4.7.23	132,670.81	121,405.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-70,994,725.81	-337,395,889.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-70,994,725.81	-337,395,889.08
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-70,994,725.81	-337,395,889.08

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,583,454,607. 59	-	-552,030,446.0 2	2,031,424,161.5 7
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,583,454,607. 59	-	-552,030,446.0 2	2,031,424,161.5 7
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-418,483,614.8 9	-	15,785,340.15	-402,698,274.74
(一)、综合收益总额	-	-	-70,994,725.81	-70,994,725.81
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-418,483,614.8 9	-	86,780,065.96	-331,703,548.93

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	4,517,749.45	-	-914,452.86	3,603,296.59
2. 基金赎回款	-423,001,364.34	-	87,694,518.82	-335,306,845.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,164,970,992.70	-	-536,245,105.87	1,628,725,886.83
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	3,020,856,729.47	-	4,506,006.21	3,025,362,735.68
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)	3,020,856,729.47	-	4,506,006.21	3,025,362,735.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,728,943.73	-	-338,682,011.11	-328,953,067.38
(一)、综合收益总额	-	-	-337,395,889.08	-337,395,889.08
(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)	9,728,943.73	-	-1,286,122.03	8,442,821.70

其中：1. 基金申购款	9,728,943.73	-	-1,286,122.03	8,442,821.70
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	3,030,585,673.20	-	-334,176,004.90	2,696,409,668.30

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

银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2021]1600号《关于准予银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册,由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,007,461,198.19元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0714号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年7月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,007,928,146.00份基金份额,其中认购资金利息折合466,947.81份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于国内依法发行上市的股票(包括主板股票、创业板股票、存

托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、现金、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60% - 95%(投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%)。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%+中债综合指数(全价)收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。



对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,127,987.91
等于：本金	4,127,660.98
加：应计利息	326.93
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	4,127,987.91

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,574,353,493.82	-	1,495,717,234.37	-78,636,259.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	106,200,692.27	1,569,023.42	108,053,043.42	283,327.73
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	106,200,692.27	1,569,023.42	108,053,043.42	283,327.73
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,680,554,186.09	1,569,023.42	1,603,770,277.79	-78,352,931.72

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-11,735.83	-
银行间市场	-	-
合计	-11,735.83	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,689,061.83
其中：交易所市场	1,689,061.83
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	231,535.04
合计	1,920,596.87

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,583,454,607.59	2,583,454,607.59
本期申购	4,517,749.45	4,517,749.45
本期赎回（以“-”号填列）	-423,001,364.34	-423,001,364.34
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,164,970,992.70	2,164,970,992.70

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-532,321,130.50	-19,709,315.52	-552,030,446.02
本期利润	-23,401,703.65	-47,593,022.16	-70,994,725.81
本期基金份额交易产生的变动数	82,012,124.75	4,767,941.21	86,780,065.96
其中：基金申购款	-890,914.60	-23,538.26	-914,452.86
基金赎回款	82,903,039.35	4,791,479.47	87,694,518.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-473,710,709.40	-62,534,396.47	-536,245,105.87

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	16,761.11
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	86,760.76
其他	7,963.29
合计	111,485.16

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-18,614,207.43
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	-18,614,207.43

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	2,890,520,712.95

减：卖出股票成本总额	2,901,468,098.65
减：交易费用	7,666,821.73
买卖股票差价收入	-18,614,207.43

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,034,475.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-731,480.77
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	302,994.71

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,066,040.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,602,157.14
减：应计利息总额	194,968.83
减：交易费用	395.32
买卖债券差价收入	-731,480.77

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,184,970.31
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	11,184,970.31

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-47,593,022.16
股票投资	-48,075,582.10
债券投资	482,559.94
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	-47,593,022.16

#### 6.4.7.21 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	57,027.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	16,135.77
合计	132,670.81

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	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

平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人、基金代销机构
--------------------	--------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
东北证券	-	-	877,358,997.48	11.63
西南证券	598,586,565.05	10.77	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
东北证券	-	-	224,597,000.80	59.19

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
东北证券	-	-	10,448,900,000.00	22.14

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
西南证券	437,747.10	10.71	437,747.10	25.92



关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东北证券	641,608.66	11.56	266,782.45	9.89

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,327,818.74	19,620,345.49
其中：支付销售机构的客户维护费	6,831,217.59	9,342,282.11

注：支付基金管理人银华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,387,969.78	3,270,057.66

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

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

注：无。

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

注：无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

注：无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	4,127,987.91	16,761.11	10,570,504.23	68,351.25

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按同业利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

注：无。

## 6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

### 6.4.13.3 流动性风险

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

份额持有人可按合同要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,127,987.91	-	-	-	4,127,987.91
结算备付金	6,506,585.04	-	-	-	6,506,585.04

存出保证金	780,986.84	-	-	-	780,986.84
交易性金融资产	108,053,043.42	-	-	-1,495,717,234.37	1,603,770,277.79
买入返售金融资产	-11,735.83	-	-	-	-11,735.83
应收股利	-	-	-	2,824,527.67	2,824,527.67
应收申购款	-	-	-	26,929.78	26,929.78
应收清算款	-	-	-	35,077,504.09	35,077,504.09
资产总计	119,456,867.38	-	-	-1,533,646,195.91	1,653,103,063.29
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,406,402.41	5,406,402.41
应付管理人报酬	-	-	-	2,081,569.50	2,081,569.50
应付托管费	-	-	-	346,928.23	346,928.23
应付清算款	-	-	-	14,621,679.45	14,621,679.45
其他负债	-	-	-	1,920,596.87	1,920,596.87
负债总计	-	-	-	24,377,176.46	24,377,176.46
利率敏感度缺口	119,456,867.38	-	-	-1,509,269,019.45	1,628,725,886.83
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,959,554.74	-	-	-	6,959,554.74
结算备付金	8,925,022.34	-	-	-	8,925,022.34
存出保证金	1,272,989.12	-	-	-	1,272,989.12
交易性金融资产	108,920,954.52	8,390,131.52	2,016,608.74	1,779,461,769.63	1,898,789,464.41
买入返售金融资产	113,773,518.16	-	-	-	113,773,518.16
应收申购款	-	-	-	24,879.02	24,879.02
应收清算款	-	-	-	16,091,501.17	16,091,501.17
资产总计	239,852,038.88	8,390,131.52	2,016,608.74	1,795,578,149.82	2,045,836,928.96
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,339,594.43	1,339,594.43
应付管理人报酬	-	-	-	2,609,211.20	2,609,211.20
应付托管费	-	-	-	434,868.54	434,868.54
应付清算款	-	-	-	7,412,894.61	7,412,894.61
应交税费	-	-	-	243.51	243.51
其他负债	-	-	-	2,615,955.10	2,615,955.10
负债总计	-	-	-	14,412,767.39	14,412,767.39
利率敏感度缺口	239,852,038.88	8,390,131.52	2,016,608.74	1,781,165,382.43	2,031,424,161.57

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	+25个基点	-48,015.02	-178,697.44
-25个基点	48,015.02	178,697.44	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	313,570,024.51	-	313,570,024.51
资产合计	-	313,570,024.51	-	313,570,024.51
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	313,570,024.51	-	313,570,024.51
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	517,172,128.09	-	517,172,128.09
资产合计	-	517,172,128.09	-	517,172,128.09
以外币计价的负债				

负债合计	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	517,172,128.09	517,172,128.09

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化率变化 5%，其他变量不变		
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币 5%	15,678,501.23	25,858,606.40
	港币-5%	-15,678,501.23	-25,858,606.40

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,495,717,234.37	91.83	1,779,461,769.63	87.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	108,053,043.42	6.63	119,327,694.78	5.87
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	1,603,770,277.79	98.47	1,898,789,464.41	93.47

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	85,137,487.23	102,608,020.12
	业绩比较基准下降 5%	-85,137,487.23	-102,608,020.12

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,495,717,234.37	1,768,096,553.32



第二层次	108,053,043.42	130,569,548.76
第三层次	-	123,362.33
合计	1,603,770,277.79	1,898,789,464.41

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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	1,495,717,234.37	90.48
	其中：股票	1,495,717,234.37	90.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	108,053,043.42	6.54
	其中：债券	108,053,043.42	6.54
	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	-11,735.83	-0.00
	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	10,634,572.95	0.64

8	其他各项资产	38,709,948.38	2.34
9	合计	1,653,103,063.29	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 313,570,024.51 元，占期末净值比例为 19.25%。

## 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	5,929,630.00	0.36
B	采矿业	59,442,862.80	3.65
C	制造业	554,852,671.16	34.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55,893,917.10	3.43
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,872,753.17	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	98,984,024.28	6.08
H	住宿和餐饮业	43,569,309.90	2.68
I	信息传输、软件和信息技术服务业	180,117,315.26	11.06
J	金融业	74,332,281.48	4.56
K	房地产业	17,327,063.00	1.06
L	租赁和商务服务业	25,430,265.91	1.56
M	科学研究和技术服务业	12,842,091.00	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	28,677,628.80	1.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	19,875,396.00	1.22
S	综合	-	-
	合计	1,182,147,209.86	72.58

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	79,549,195.03	4.88
消费者常用品	21,391,982.80	1.31
能源	15,571,873.41	0.96
金融	31,905,011.88	1.96
医疗保健	47,389,476.96	2.91
工业	4,600,678.36	0.28
信息技术	4,261,096.53	0.26

电信服务	59,135,363.87	3.63
公用事业	28,498,364.92	1.75
地产建筑业	21,266,980.75	1.31
合计	313,570,024.51	19.25

### 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	601816	京沪高铁	10,535,148	55,414,878.48	3.40
2	00700	腾讯控股	140,500	42,954,863.81	2.64
3	03690	美团-W	350,550	39,527,370.88	2.43
4	600938	中国海油	1,229,500	22,278,540.00	1.37
4	00883	中国海洋石油	1,508,000	15,571,873.41	0.96
5	688111	金山办公	66,427	31,368,157.94	1.93
6	600872	中炬高新	816,500	30,039,035.00	1.84
7	300033	同花顺	167,624	29,381,134.72	1.80
8	603136	天目湖	1,111,536	28,677,628.80	1.76
9	301073	君亭酒店	761,914	27,695,573.90	1.70
10	600426	华鲁恒升	896,700	27,465,921.00	1.69
11	300750	宁德时代	105,109	24,047,888.11	1.48
12	000063	中兴通讯	479,200	21,822,768.00	1.34
13	603885	吉祥航空	1,403,700	21,659,091.00	1.33
14	600900	长江电力	977,500	21,563,650.00	1.32
15	00570	中国中药	6,380,000	21,470,148.26	1.32
16	01211	比亚迪股份	64,500	14,866,927.50	0.91
16	002594	比亚迪	21,000	5,423,670.00	0.33
17	600036	招商银行	611,201	20,022,944.76	1.23
18	600197	伊力特	725,063	19,699,961.71	1.21
19	301363	美好医疗	441,996	19,443,404.04	1.19
20	301102	兆讯传媒	708,293	19,031,832.91	1.17
21	300026	红日药业	3,500,100	18,970,542.00	1.16
22	002603	以岭药业	732,345	18,813,943.05	1.16
23	600600	青岛啤酒	177,400	18,383,962.00	1.13
24	603444	吉比特	36,900	18,121,959.00	1.11
25	002223	鱼跃医疗	490,300	17,645,897.00	1.08
26	002557	洽洽食品	416,700	17,313,885.00	1.06
27	02380	中国电力	6,492,000	17,238,223.18	1.06
28	603501	韦尔股份	167,265	16,398,660.60	1.01
29	601579	会稽山	1,372,024	16,176,162.96	0.99
30	600941	中国移动	165,610	15,451,413.00	0.95
31	002371	北方华创	47,700	15,151,905.00	0.93
32	600905	三峡能源	2,820,830	15,147,857.10	0.93
33	300677	英科医疗	682,500	15,015,000.00	0.92

34	002624	完美世界	876,900	14,810,841.00	0.91
35	01336	新华保险	761,900	14,505,728.01	0.89
36	688981	中芯国际	283,281	14,311,356.12	0.88
37	600487	亨通光电	972,800	14,261,248.00	0.88
38	00027	银河娱乐	305,000	13,975,833.83	0.86
39	600633	浙数文化	859,700	13,935,737.00	0.86
40	603986	兆易创新	130,800	13,897,500.00	0.85
41	600522	中天科技	852,644	13,565,566.04	0.83
42	002555	三七互娱	375,223	13,087,778.24	0.80
43	00291	华润啤酒	272,000	12,940,173.70	0.79
44	603659	璞泰来	336,940	12,877,846.80	0.79
45	603259	药明康德	206,100	12,842,091.00	0.79
46	601360	三六零	981,900	12,313,026.00	0.76
47	601728	中国电信	2,132,000	12,003,160.00	0.74
48	688036	传音控股	79,964	11,754,708.00	0.72
49	02601	中国太保	625,800	11,683,745.45	0.72
50	06049	保利物业	323,600	11,322,486.03	0.70
51	00836	华润电力	690,000	11,260,141.74	0.69
52	601021	春秋航空	192,600	11,068,722.00	0.68
53	603979	金诚信	349,881	10,881,299.10	0.67
54	09966	康宁杰瑞制药-B	1,531,000	10,558,404.32	0.65
55	600373	中文传媒	784,800	10,453,536.00	0.64
56	601007	金陵饭店	1,214,100	10,344,132.00	0.64
57	600886	国投电力	816,000	10,322,400.00	0.63
58	00013	和黄医药	600,000	10,200,786.72	0.63
59	605358	立昂微	272,900	10,023,617.00	0.62
60	301195	北路智控	214,666	9,994,848.96	0.61
61	01024	快手-W	202,200	9,983,024.26	0.61
62	00688	中国海外发展	631,500	9,944,494.72	0.61
63	600489	中金黄金	954,090	9,855,749.70	0.61
64	002045	国光电器	589,300	9,464,158.00	0.58
65	002230	科大讯飞	137,300	9,330,908.00	0.57
66	000988	华工科技	245,300	9,323,853.00	0.57
67	600048	保利发展	697,600	9,089,728.00	0.56
68	600309	万华化学	102,794	9,029,424.96	0.55
69	000860	顺鑫农业	266,300	8,971,647.00	0.55
70	000539	粤电力A	1,213,700	8,860,010.00	0.54
71	01458	周黑鸭	2,986,000	8,451,809.10	0.52
72	600176	中国巨石	594,627	8,419,918.32	0.52
73	600641	万业企业	431,500	8,237,335.00	0.51
74	000858	五粮液	50,300	8,227,571.00	0.51
75	600986	浙文互联	1,283,400	8,213,760.00	0.50
76	600705	中航产融	2,121,700	8,126,111.00	0.50

77	600195	中牧股份	688,600	8,042,848.00	0.49
78	09922	九毛九	674,000	7,978,962.44	0.49
79	603345	安井食品	53,397	7,838,679.60	0.48
80	601658	邮储银行	1,575,400	7,703,706.00	0.47
81	688012	中微公司	46,862	7,331,559.90	0.45
82	600256	广汇能源	1,000,000	6,860,000.00	0.42
83	002049	紫光国微	72,503	6,760,904.75	0.42
84	688475	萤石网络	157,174	6,736,477.64	0.41
85	300860	锋尚文化	120,000	6,652,800.00	0.41
86	002567	唐人神	999,200	6,644,680.00	0.41
87	688409	富创精密	59,915	6,530,735.00	0.40
88	300662	科锐国际	180,900	6,398,433.00	0.39
89	09626	哔哩哔哩-W	57,600	6,197,475.80	0.38
90	301367	怡和嘉业	41,723	6,189,189.82	0.38
91	600050	中国联通	1,250,000	6,000,000.00	0.37
92	603477	巨星农牧	177,800	5,929,630.00	0.36
93	600004	白云机场	411,920	5,906,932.80	0.36
94	00388	香港交易所	21,000	5,715,538.42	0.35
95	600754	锦江酒店	130,600	5,529,604.00	0.34
96	000975	银泰黄金	465,800	5,449,860.00	0.33
97	000938	紫光股份	167,500	5,334,875.00	0.33
98	000895	双汇发展	217,200	5,319,228.00	0.33
99	002372	伟星新材	254,900	5,235,646.00	0.32
100	01548	金斯瑞生物科技	318,000	5,160,137.66	0.32
101	600919	江苏银行	684,200	5,028,870.00	0.31
102	001965	招商公路	514,000	4,934,400.00	0.30
103	000625	长安汽车	376,900	4,873,317.00	0.30
104	600859	王府井	246,223	4,872,753.17	0.30
105	002709	天赐材料	117,200	4,827,468.00	0.30
106	002517	恺英网络	297,900	4,688,946.00	0.29
107	00564	郑煤机	730,600	4,600,678.36	0.28
108	603893	瑞芯微	59,300	4,320,005.00	0.27
109	00268	金蝶国际	441,000	4,261,096.53	0.26
110	600988	赤峰黄金	305,900	4,117,414.00	0.25
111	002966	苏州银行	621,300	4,069,515.00	0.25
112	002475	立讯精密	123,900	4,020,555.00	0.25
113	688153	唯捷创芯	52,214	3,819,976.24	0.23
114	300418	昆仑万维	91,000	3,665,480.00	0.23
115	688099	晶晨股份	43,028	3,628,120.96	0.22
116	688246	嘉和美康	83,668	3,503,179.16	0.22
117	600528	中铁工业	342,500	3,383,900.00	0.21
118	002531	天顺风能	213,100	3,245,513.00	0.20
119	300389	艾比森	158,750	3,233,737.50	0.20

120	00839	中教控股	569,000	3,200,100.38	0.20
121	601928	凤凰传媒	242,900	2,769,060.00	0.17
122	600425	青松建化	605,300	2,675,426.00	0.16
123	603008	喜临门	99,500	2,505,410.00	0.15
124	600059	古越龙山	4,000	41,520.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	51,970,795.00	2.56
2	002603	以岭药业	46,775,332.10	2.30
3	600705	中航产融	37,219,069.58	1.83
4	300026	红日药业	35,764,962.00	1.76
5	000860	顺鑫农业	34,538,072.00	1.70
6	301363	美好医疗	34,488,630.30	1.70
7	002906	华阳集团	33,605,394.18	1.65
8	002555	三七互娱	33,522,628.22	1.65
9	000002	万科 A	33,131,074.00	1.63
10	002223	鱼跃医疗	32,683,383.10	1.61
11	600037	歌华有线	32,146,418.00	1.58
12	600859	王府井	31,610,989.89	1.56
13	301073	君亭酒店	31,371,016.04	1.54
14	600872	中炬高新	30,919,363.97	1.52
15	600426	华鲁恒升	30,775,781.70	1.51
16	300474	景嘉微	30,357,873.10	1.49
17	300033	同花顺	29,729,626.53	1.46
18	000568	泸州老窖	29,544,131.14	1.45
19	600600	青岛啤酒	27,538,744.00	1.36
20	002405	四维图新	27,376,975.00	1.35

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	600197	伊力特	48,998,246.96	2.41
2	600900	长江电力	46,983,453.23	2.31
3	000002	万科 A	46,566,739.00	2.29
4	000568	泸州老窖	36,731,750.30	1.81
5	600536	中国软件	36,301,379.84	1.79
6	600009	上海机场	35,848,222.26	1.76
7	600037	歌华有线	33,606,759.00	1.65

8	300113	顺网科技	32,693,550.20	1.61
9	000860	顺鑫农业	32,289,595.44	1.59
10	300339	润和软件	32,121,130.25	1.58
11	688072	拓荆科技	29,988,646.97	1.48
12	600702	舍得酒业	29,634,634.60	1.46
13	000999	华润三九	29,463,538.69	1.45
14	688111	金山办公	29,359,458.09	1.45
15	002405	四维图新	29,201,459.31	1.44
16	600258	首旅酒店	28,422,141.90	1.40
17	300474	景嘉微	27,486,159.71	1.35
18	02331	李宁	27,056,817.01	1.33
19	600705	中航产融	26,841,839.83	1.32
20	002906	华阳集团	26,393,651.60	1.30

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	2,665,799,145.49
卖出股票收入（成交）总额	2,890,520,712.95

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	108,053,043.42	6.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	108,053,043.42	6.63

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	532,000	54,156,477.70	3.33
2	019688	22 国债 23	533,000	53,896,565.72	3.31

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

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

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	780,986.84
2	应收清算款	35,077,504.09
3	应收股利	2,824,527.67
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,929.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,709,948.38

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。



### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
339,783	6,371.63	3,924,726.48	0.18	2,161,046,266.22	99.82

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,858,811.93	0.09

### 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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门 负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 7 月 15 日) 基金份额总额	3,007,928,146.00
本报告期期初基金份额总额	2,583,454,607.59
本报告期基金总申购份额	4,517,749.45
减：本报告期基金总赎回份额	423,001,364.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,164,970,992.70

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

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	4	2,712,493,949.34	48.82	1,983,643.65	48.51	-
中金公司	2	1,268,505,741.25	22.83	927,661.12	22.69	-
国盛证券	2	784,332,316.56	14.12	599,386.83	14.66	-

西南证券	2	598,586,565 .05	10.77	437,747.10	10.71	-
金元证券	2	137,967,643 .78	2.48	100,896.31	2.47	新增 2个 交易 单元
广发证券	2	54,392,248. 83	0.98	39,777.06	0.97	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	1,919,000,00 0.00	46.70	-	-
中金公司	15,960,609 .46	44.52	1,840,200,00 0.00	44.78	-	-
国盛证券	11,965,080 .00	33.38	349,800,000. 00	8.51	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
广发证	7,921,654.	22.10	-	-	-	-

券	07					
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 1 月 20 日
3	《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 3 月 31 日
5	《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 20 日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 4 月 20 日
7	《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新(2023 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 16 日
8	《银华多元回报一年持有期混合型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	2023 年 6 月 16 日

		网站	
--	--	----	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华多元回报一年持有期混合型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住所。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

2023 年 8 月 29 日