

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券
投资基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	51

8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	71
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	71
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§ 13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§ 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	18,363,953.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
下属分级基金的交 易代码	005260	005261
报告期末下属分级 基金的份额总额	17,582,906.24 份	781,046.82 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	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	银华稳健增 利灵活配置 混合发起式 A	银华稳健增 利灵活配置 混合发起式 C	银华稳健增 利灵活配置 混合发起式 A	银华稳健增 利灵活配置 混合发起式 C	银华稳健增 利灵活配置 混合发起式 A	银华稳健增 利灵活配置 混合发起式 C
本期已实现 收益	1,258,249. 58	39,346.09	-2,381,521. .65	-373,401.6 6	-5,032,900. .32	-489,345.9 7
本期利润	2,317,420. 91	229,828.69	-1,708,282. .96	166,468.25	-6,339,287. .73	-1,034,741. .30
加权平均基 金份额本期	0.1311	0.1862	-0.0894	0.0890	-0.3229	-0.5027

利润						
本期加权平均净值利润率	9.61%	13.98%	-6.02%	6.10%	-20.84%	-33.46%
本期基金份额净值增长率	9.80%	9.35%	-6.69%	-7.02%	-17.99%	-18.28%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	8,796,603.45	363,826.17	6,593,770.32	3,200,321.88	10,514,684.99	6,496,438.19
期末可供分配基金份额利润	0.5003	0.4658	0.3664	0.3405	0.4643	0.4417
期末基金资产净值	26,379,509.69	1,144,872.99	24,587,690.43	12,598,924.46	33,163,322.43	21,203,656.79
期末基金份额净值	1.5003	1.4658	1.3664	1.3405	1.4643	1.4417
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	50.03%	46.58%	36.64%	34.05%	46.43%	44.17%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.58%	1.76%	0.75%	0.88%	0.83%	0.88%
过去六个月	13.61%	1.77%	9.05%	0.84%	4.56%	0.93%
过去一年	9.80%	1.56%	9.47%	0.70%	0.33%	0.86%

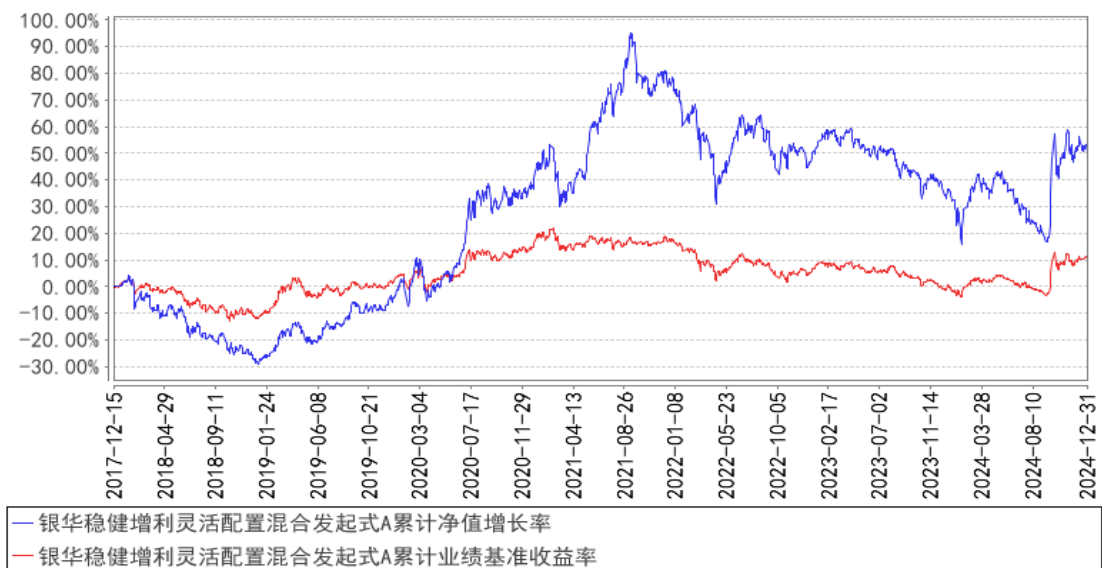
过去三年	-15.97%	1.24%	-6.56%	0.59%	-9.41%	0.65%
过去五年	54.86%	1.29%	6.62%	0.61%	48.24%	0.68%
自基金合同生效起至今	50.03%	1.22%	10.06%	0.61%	39.97%	0.61%

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

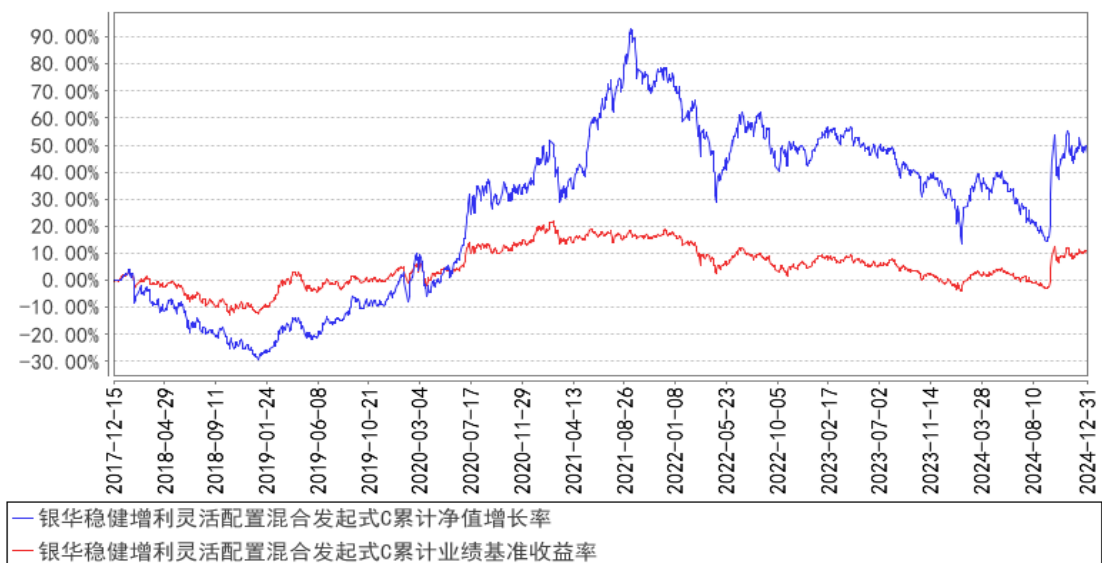
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.48%	1.76%	0.75%	0.88%	0.73%	0.88%
过去六个月	13.41%	1.77%	9.05%	0.84%	4.36%	0.93%
过去一年	9.35%	1.56%	9.47%	0.70%	-0.12%	0.86%
过去三年	-16.91%	1.24%	-6.56%	0.59%	-10.35%	0.65%
过去五年	52.07%	1.29%	6.62%	0.61%	45.45%	0.68%
自基金合同生效起至今	46.58%	1.22%	10.06%	0.61%	36.52%	0.61%

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



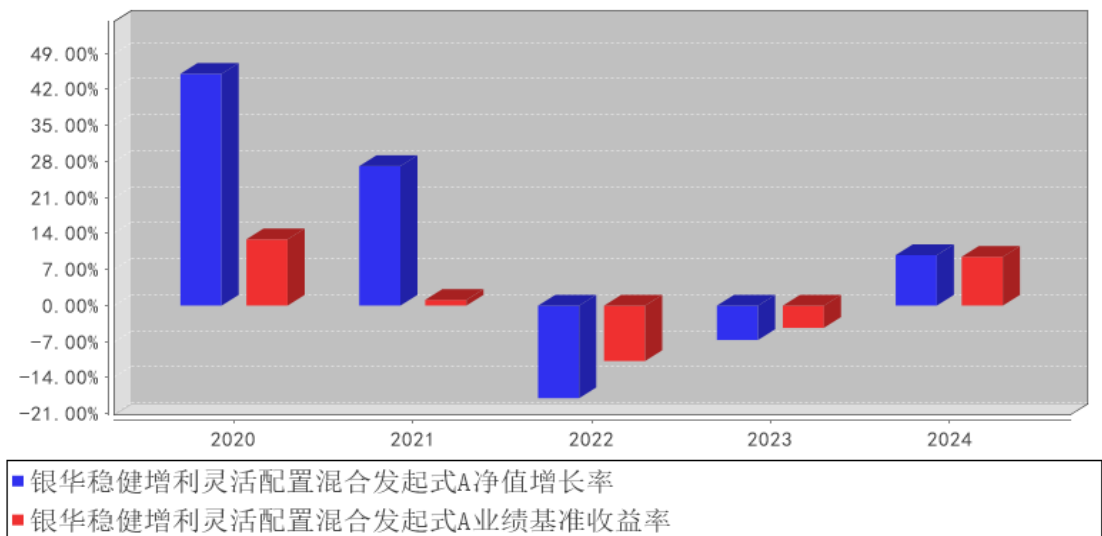
银华稳健增利灵活配置混合发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



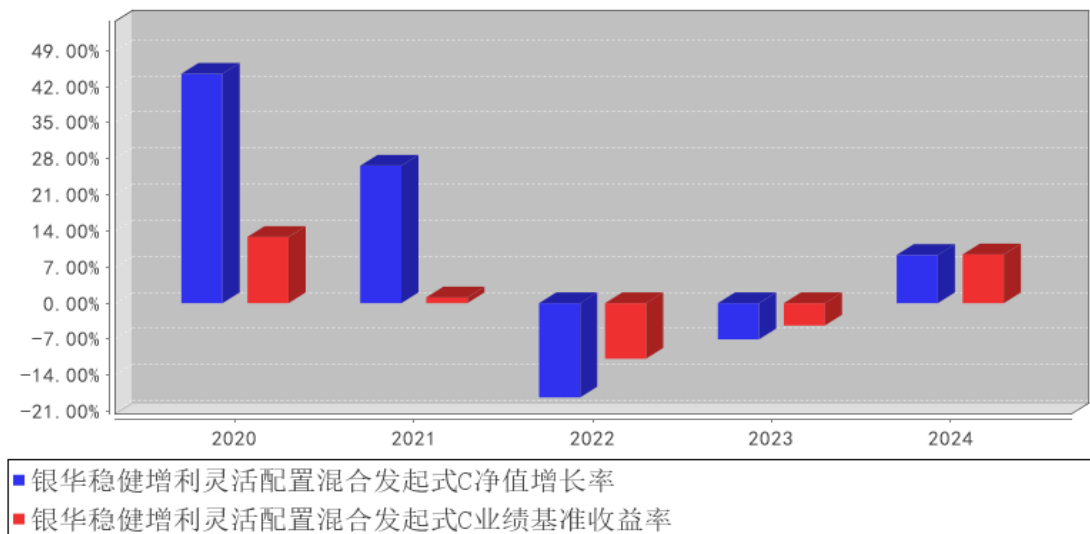
注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



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



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理股份有限公司成立于 2001 年 5 月，注册资本 2.222 亿人民币，是一家全牌照、综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至 2024 年末，银华基金管理公募基金 217 只，涵盖股票型基金、指数型基金、QDII 基金、混合型基金、债券型基金及货币市场基金等各类产品，拥有完善的产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自 2020 年起连续四年实现经营层面碳中和。

银华基金始终坚持以客户为中心，持有人利益至上，做价值投资理念的坚定追随者，不盲目追求短期收益，注重控制投资风险，以细水长流的方式积蓄力量，追求长期持续的稳健回报。

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		
张凯先生	本基金的基金经理	2021年9月28日	-	15.5年	硕士学位。毕业于清华大学。2009年7月加入银华基金，历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理，现任量化投资部副总监、基金经理。自2012年11月14日至2020年11月25日担任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理，自2013年11月5日至2019年9月26日兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理，自2016年1月14日至2018年4月2日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自2016年4月7日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，自2016年4月25日至2018年11月30日兼任银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2020年11月29日兼任银华沪深300指数分级证券投资基金基金经理，自2019年6月28日至2021年7月23日兼任银华深证100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2019年8月29日至2020年12月31日兼任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理，自2019年12月6日至2021年9月17日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2020年11月26日至2022年7月28日兼任银华中证等权重90指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2020年11月30日起兼任银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年1月1日起兼任银华深证100指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年2月3日至2022年2月23日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2021年5月13日至2022年6月17日兼任银华中证研发创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年7月29日至2023年7月28日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年9月22日至2023年7月

					28日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年9月28日起兼任银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2021年11月19日起兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理，自2021年12月20日至2023年7月28日兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2022年1月27日至2023年7月28日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2022年3月7日至2023年9月8日兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2022年11月24日起兼任银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年8月23日起兼任银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2023年12月1日起兼任银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
杨腾先生	本基金的基金经理	2021年11月29日	-	12.5年	硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。2015年7月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员，量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自2021年11月29日起担任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自2021年11月29日至2023年3月16日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2025年3月7日起兼任银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
马君女士	本基金的基金经理	2017年12月15日	2024年9月26日	16.5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

		日		<p>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 日至 2024 年 9 月 26 日兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 11 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理，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</p>
--	--	---	--	---

					<p>投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 15 日起兼任银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金(QDII)基金经理，自 2023 年 3 月 17 日起兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 9 月 6 日起兼任银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 1 月 3 日起兼任银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 4 月 25 日起兼任银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 9 月 26 日起兼任银华中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 11 月 13 日起兼任银华中证 A500 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。具有从业资格。国籍：中国。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 7 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

2024 年中，国内外的宏观经济运行都呈现出一些新的特点。国内方面，经济主基调是在新旧转换的过程中寻求质与量的平衡点。分经济部门来看，居民消费领域仍然延续了此前的复苏趋势，而商务活动的复苏进程仍然较弱。这样的消费结构使消费领域呈现年节化、家庭化、中低价位段的特征。此外，宏观政策在诸多方面提升了支持力度，包括地产、化债、消费补贴、资本市场支持等。国外方面，美联储三次下调联邦基金利率，正式进入降息周期；而另一方面，伴随美国政府的换届，其货币、财政、关税政策仍存在预期不明朗之处。在上述因素的作用下，A 股市场主要指数在 2024 年明显反弹。行业层面，银行、非银行金融、家电等行业表现领先，医药、农林牧渔、消费者服务等行业表现落后。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 基金份额净值为 1.5003 元,本报告期基金份额净值增长率为 9.80%;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 1.4658 元,本报告期基金份额净值增长率为 9.35%;业绩比较基准收益率为 9.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年我们认为,宏观政策对经济的支撑作用有望逐步显现。从更远的视角来看,经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生,我们正处于这样的进程中。随着这个进程的深入,经济活动的扩张、收入水平的提升,都将是一个缓慢但持续的过程;而随着新旧更替的深入,经济也将会逐渐出现一些新的特点。未来一段时期,国内政策、汇率水平、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量,我们也将对此进行持续的观察。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以

及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情形的时间范围为 2023 年 8 月 3 日至 2024 年 12 月 31 日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。自 2024 年 6 月 1 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70026197_A54 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经</p>

	营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	石静筠 朱燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2025年03月26日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,512,602.37	2,139,490.04
结算备付金		1,159.44	115,523.78
存出保证金		2,443.72	2,148.02
交易性金融资产	7.4.7.2	25,042,165.04	24,015,734.32
其中：股票投资		25,042,165.04	24,015,734.32
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,404.08	11,006,199.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	653.00	-
资产总计		27,568,427.65	37,279,095.95
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	59.29
应付赎回款		82.33	6,244.40

应付管理人报酬		14,218.18	13,753.34
应付托管费		3,554.53	3,438.33
应付销售服务费		345.16	702.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	25,844.77	68,283.60
负债合计		44,044.97	92,481.06
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	18,363,953.06	27,392,522.69
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	9,160,429.62	9,794,092.20
净资产合计		27,524,382.68	37,186,614.89
负债和净资产总计		27,568,427.65	37,279,095.95

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 18,363,953.06 份，其中银华稳健增利灵活配置混合发起式 A 基金份额总额 17,582,906.24 份，基金份额净值 1.5003 元。银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额总额 781,046.82 份，基金份额净值 1.4658 元。

7.2 利润表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		2,753,528.82	-1,250,994.58
1. 利息收入		10,372.68	12,906.23
其中：存款利息收入	7.4.7.13	10,372.68	12,906.23
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,405,241.64	-2,731,842.04
其中：股票投资收益	7.4.7.14	934,502.75	-3,224,426.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	3,185.89
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	470,738.89	489,398.61
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	1,249,653.93	1,213,108.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	88,260.57	254,832.63
减：二、营业总支出		206,279.22	290,820.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	154,628.62	187,194.87
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	38,657.13	46,798.83
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	5,791.37	9,689.67
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	7,202.10	47,136.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,547,249.60	-1,541,814.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,547,249.60	-1,541,814.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,547,249.60	-1,541,814.71

7.3 净资产变动表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	27,392,522.69	-	9,794,092.20	37,186,614.89

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	27,392,522.69	-	9,794,092.20	37,186,614.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,028,569.63	-	-633,662.58	-9,662,232.21
(一)、综合收益总额	-	-	2,547,249.60	2,547,249.60
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-9,028,569.63	-	-3,180,912.18	-12,209,481.81
其中：1. 基金申购款	5,483,237.20	-	1,896,672.58	7,379,909.78
2. 基金赎回款	-14,511,806.83	-	-5,077,584.76	-19,589,391.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	18,363,953.06	-	9,160,429.62	27,524,382.68
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	37,355,856.04	-	17,011,123.18	54,366,979.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	37,355,856.04	-	17,011,123.18	54,366,979.22

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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]857号《关于准予银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的注册，由银华基金管理股份有限公司于2017年11月13日至2017年12月8日向社会公开募集，基金合同于2017年12月15日生效，首次设立募集规模为13,175,905.27份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管

理人及注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据所收取的认购费用、申购费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为 A 类和 C 类不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。

本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分

别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

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

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》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附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

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

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

7.4.6.4 个人所得税

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

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

市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,512,602.37	2,139,490.04
等于：本金	2,512,334.39	2,139,298.69
加：应计利息	267.98	191.35
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	2,512,602.37	2,139,490.04

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	24,008,344.19	-	25,042,165.04	1,033,820.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	24,008,344.19	-	25,042,165.04	1,033,820.85
项目	上年度末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	24,231,567.40	-	24,015,734.32	-215,833.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		24,231,567.40	-	24,015,734.32	-215,833.08

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	653.00	-
待摊费用	-	-
合计	653.00	-

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31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	19,615.26	23,283.60
其中：交易所市场	19,615.26	23,283.60
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	6,229.51	45,000.00
合计	25,844.77	68,283.60

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,993,920.11	17,993,920.11
本期申购	418,197.83	418,197.83
本期赎回（以“-”号填列）	-829,211.70	-829,211.70
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	17,582,906.24	17,582,906.24

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	9,398,602.58	9,398,602.58
本期申购	5,065,039.37	5,065,039.37
本期赎回 (以“-”号填列)	-13,682,595.13	-13,682,595.13
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	781,046.82	781,046.82

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

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,765,176.48	-4,171,406.16	6,593,770.32
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,765,176.48	-4,171,406.16	6,593,770.32
本期利润	1,258,249.58	1,059,171.33	2,317,420.91
本期基金份额交易产生的变动数	-262,803.98	148,216.20	-114,587.78
其中：基金申购款	222,223.24	-7,108.36	215,114.88
基金赎回款	-485,027.22	155,324.56	-329,702.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,760,622.08	-2,964,018.63	8,796,603.45

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,352,278.87	-2,151,956.99	3,200,321.88
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,352,278.87	-2,151,956.99	3,200,321.88
本期利润	39,346.09	190,482.60	229,828.69
本期基金份额交易产生的变动数	-4,897,307.38	1,830,982.98	-3,066,324.40

其中：基金申购款	2,694,507.03	-1,012,949.33	1,681,557.70
基金赎回款	-7,591,814.41	2,843,932.31	-4,747,882.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	494,317.58	-130,491.41	363,826.17

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	8,887.07	10,199.19
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	1,447.54	2,585.25
其他	38.07	121.79
合计	10,372.68	12,906.23

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	934,502.75	-3,224,426.54
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	934,502.75	-3,224,426.54

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	130,567,259.08	232,301,684.93
减：卖出股票成本总额	129,466,955.65	235,191,036.78
减：交易费用	165,800.68	335,074.69

买卖股票差价收入	934,502.75	-3,224,426.54
----------	------------	---------------

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	-	2,543.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	642.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	3,185.89

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	203,340.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	199,358.00
减：应计利息总额	-	3,340.00
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	642.00

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	470,738.89	489,398.61
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	470,738.89	489,398.61

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	1,249,653.93	1,213,108.60
股票投资	1,249,653.93	1,213,108.60
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	1,249,653.93	1,213,108.60

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
基金赎回费收入	88,084.46	254,355.59
基金转换费收入	176.11	477.04
合计	88,260.57	254,832.63

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	6,229.51	45,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	972.59	2,136.76
合计	7,202.10	47,136.76

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司(“西南证券”)	基金管理人的股东
第一创业证券股份有限公司(“第一创业”)	基金管理人的股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司(“东北证券”)	基金管理人的股东
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
银华基金管理股份有限公司(“银华基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
银华长安资本管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	154,628.62	187,194.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,714.59	16,038.33
应支付基金管理人的净管理费	146,914.03	171,156.54

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	38,657.13	46,798.83

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金	-	673.29	673.29
中国工商银行	-	272.33	272.33

合计	-	945.62	945.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金	-	823.53	823.53
中国工商银行	-	297.74	297.74
合计	-	1,121.27	1,121.27

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

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	56.88%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,400.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	55.58%	-

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,512,602.37	8,887.07	2,139,490.04	10,199.19

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

自2024年6月1日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总 额	备注
002252	上海莱士	2024年12月23日	重大事项停牌	7.22	2025年1月7日	6.93	1,900	14,286.00	13,718.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可按合同要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本

基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,512,602.37	-	-	-	2,512,602.37
结算备付金	1,159.44	-	-	-	1,159.44
存出保证金	2,443.72	-	-	-	2,443.72
交易性金融资产	-	-	-	25,042,165.04	25,042,165.04
应收申购款	-	-	-	9,404.08	9,404.08
其他资产	-	-	-	653.00	653.00
资产总计	2,516,205.53	-	-	25,052,222.12	27,568,427.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	82.33	82.33
应付管理人报酬	-	-	-	14,218.18	14,218.18
应付托管费	-	-	-	3,554.53	3,554.53
应付销售服务费	-	-	-	345.16	345.16

其他负债	-	-	-	25,844.77	25,844.77
负债总计	-	-	-	44,044.97	44,044.97
利率敏感度缺口	2,516,205.53	-	-	25,008,177.15	27,524,382.68
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,139,490.04	-	-	-	2,139,490.04
结算备付金	115,523.78	-	-	-	115,523.78
存出保证金	2,148.02	-	-	-	2,148.02
交易性金融资产	-	-	-	24,015,734.32	24,015,734.32
应收申购款	-	-	-	11,006,199.79	11,006,199.79
资产总计	2,257,161.84	-	-	35,021,934.11	37,279,095.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,244.40	6,244.40
应付管理人报酬	-	-	-	13,753.34	13,753.34
应付托管费	-	-	-	3,438.33	3,438.33
应付清算款	-	-	-	59.29	59.29
应付销售服务费	-	-	-	702.10	702.10
其他负债	-	-	-	68,283.60	68,283.60
负债总计	-	-	-	92,481.06	92,481.06
利率敏感度缺口	2,257,161.84	-	-	34,929,453.05	37,186,614.89

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金持有的利率敏感性资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023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	25,042,165.04	90.98	24,015,734.32	64.58
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	25,042,165.04	90.98	24,015,734.32	64.58

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	2,784,810.78	1,975,870.92
	业绩比较基准下降 5%	-2,784,810.78	-1,975,870.92

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	25,028,447.04	23,993,686.32
第二层次	13,718.00	22,048.00
第三层次	-	-
合计	25,042,165.04	24,015,734.32

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨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输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

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

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

注：无。

7.4.15.2 其他事项

注：无。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	25,042,165.04	90.84
	其中：股票	25,042,165.04	90.84
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	2,513,761.81	9.12
8	其他各项资产	12,500.80	0.05
9	合计	27,568,427.65	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	132,584.00	0.48
B	采矿业	898,045.12	3.26
C	制造业	15,264,316.13	55.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	806,970.00	2.93
E	建筑业	718,525.00	2.61
F	批发和零售业	505,033.68	1.83
G	交通运输、仓储和邮政业	705,945.00	2.56

H	住宿和餐饮业	55,250.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,182,717.76	7.93
J	金融业	1,893,546.70	6.88
K	房地产业	354,014.00	1.29
L	租赁和商务服务业	348,658.00	1.27
M	科学研究和技术服务业	388,822.14	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	170,535.51	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	31,684.00	0.12
Q	卫生和社会工作	112,896.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	472,622.00	1.72
S	综合	-	-
	合计	25,042,165.04	90.98

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601991	大唐发电	100,600	286,710.00	1.04
2	601717	郑煤机	20,971	272,203.58	0.99
3	002128	电投能源	12,900	252,582.00	0.92
4	002273	水晶光电	10,300	228,866.00	0.83
5	300383	光环新网	15,600	227,604.00	0.83
6	300017	网宿科技	19,300	204,001.00	0.74
7	688520	神州细胞	5,341	193,504.43	0.70
8	600219	南山铝业	47,100	184,161.00	0.67
9	300207	欣旺达	7,800	174,018.00	0.63
10	600066	宇通客车	6,300	166,194.00	0.60
11	600901	江苏金租	30,700	160,254.00	0.58
12	300054	鼎龙股份	6,000	156,120.00	0.57
13	002558	巨人网络	12,300	156,087.00	0.57
14	300136	信维通信	6,100	155,184.00	0.56
15	601288	农业银行	28,800	153,792.00	0.56
16	600519	贵州茅台	100	152,400.00	0.55
17	000728	国元证券	18,000	150,480.00	0.55
18	601298	青岛港	16,300	148,493.00	0.54
19	300803	指南针	1,500	143,925.00	0.52
20	002472	双环传动	4,600	140,852.00	0.51
21	000738	航发控制	6,300	140,112.00	0.51
22	601555	东吴证券	17,800	138,840.00	0.50

23	002831	裕同科技	5,100	138,210.00	0.50
24	002532	天山铝业	17,400	136,938.00	0.50
25	601611	中国核建	14,500	131,080.00	0.48
26	600060	海信视像	6,514	129,889.16	0.47
27	300638	广和通	6,200	124,930.00	0.45
28	688063	派能科技	3,023	121,071.15	0.44
29	002244	滨江集团	14,000	120,540.00	0.44
30	000050	深天马 A	13,200	119,196.00	0.43
31	600096	云天化	5,300	118,190.00	0.43
32	600827	百联股份	10,800	118,044.00	0.43
33	600707	彩虹股份	14,300	117,546.00	0.43
34	002939	长城证券	14,300	117,260.00	0.43
35	603658	安图生物	2,600	113,464.00	0.41
36	600737	中粮糖业	11,100	113,331.00	0.41
37	600177	雅戈尔	12,700	113,030.00	0.41
38	000830	鲁西化工	9,600	112,224.00	0.41
39	000729	燕京啤酒	9,300	111,972.00	0.41
40	600967	内蒙一机	12,975	110,287.50	0.40
41	002738	中矿资源	3,100	110,050.00	0.40
42	600143	金发科技	12,700	109,728.00	0.40
43	601179	中国西电	14,200	107,778.00	0.39
44	600109	国金证券	12,100	105,633.00	0.38
45	300474	景嘉微	1,100	102,839.00	0.37
46	600282	南钢股份	21,900	102,711.00	0.37
47	000725	京东方 A	23,200	101,848.00	0.37
48	000887	中鼎股份	7,600	99,712.00	0.36
49	600820	隧道股份	13,300	95,627.00	0.35
50	601728	中国电信	13,200	95,304.00	0.35
51	000783	长江证券	13,900	94,798.00	0.34
52	002368	太极股份	4,000	94,720.00	0.34
53	000858	五粮液	661	92,566.44	0.34
54	600637	东方明珠	11,700	90,792.00	0.33
55	600153	建发股份	8,600	90,472.00	0.33
56	600352	浙江龙盛	8,700	89,523.00	0.33
57	002044	美年健康	19,400	89,046.00	0.32
58	002507	涪陵榨菜	6,300	89,019.00	0.32
59	600998	九州通	17,174	87,930.88	0.32
60	688425	铁建重工	19,871	87,432.40	0.32
61	601155	新城控股	7,300	87,308.00	0.32
62	600497	驰宏锌锗	15,600	86,892.00	0.32
63	603156	养元饮品	3,800	86,792.00	0.32
64	002078	太阳纸业	5,800	86,246.00	0.31
65	688107	安路科技	2,899	85,752.42	0.31

66	002384	东山精密	2,882	84,154.40	0.31
67	002266	浙富控股	26,200	81,744.00	0.30
68	002414	高德红外	11,000	81,730.00	0.30
69	601857	中国石油	9,100	81,354.00	0.30
70	002294	信立泰	2,600	80,418.00	0.29
71	600028	中国石化	12,000	80,160.00	0.29
72	601988	中国银行	14,500	79,895.00	0.29
73	300296	利亚德	12,400	79,856.00	0.29
74	688158	优刻得	5,667	79,224.66	0.29
75	300001	特锐德	3,600	79,020.00	0.29
76	601668	中国建筑	13,131	78,786.00	0.29
77	601658	邮储银行	13,800	78,384.00	0.28
78	688002	睿创微纳	1,663	78,177.63	0.28
79	688567	孚能科技	6,735	78,126.00	0.28
80	600583	海油工程	14,200	77,674.00	0.28
81	601231	环旭电子	4,665	76,972.50	0.28
82	688772	珠海冠宇	4,782	76,894.56	0.28
83	601600	中国铝业	10,400	76,440.00	0.28
84	000951	中国重汽	4,501	76,426.98	0.28
85	300390	天华新能	3,300	76,065.00	0.28
86	601577	长沙银行	8,500	75,565.00	0.27
87	601318	中国平安	1,400	73,710.00	0.27
88	601098	中南传媒	4,900	73,549.00	0.27
89	002446	盛路通信	11,200	73,360.00	0.27
90	600566	济川药业	2,500	72,700.00	0.26
91	601019	山东出版	6,400	72,640.00	0.26
92	300144	宋城演艺	7,800	72,462.00	0.26
93	600755	厦门国贸	10,900	72,376.00	0.26
94	600535	天士力	5,000	72,300.00	0.26
95	301165	锐捷网络	1,000	72,200.00	0.26
96	601928	凤凰传媒	6,200	71,548.00	0.26
97	600528	中铁工业	8,800	70,928.00	0.26
98	688088	虹软科技	1,839	70,911.84	0.26
99	600941	中国移动	600	70,896.00	0.26
100	600612	老凤祥	1,300	70,551.00	0.26
101	000650	仁和药业	12,200	70,272.00	0.26
101	000778	新兴铸管	18,300	70,272.00	0.26
102	300433	蓝思科技	3,200	70,080.00	0.25
103	300776	帝尔激光	1,100	69,938.00	0.25
104	600183	生益科技	2,900	69,745.00	0.25
105	603529	爱玛科技	1,700	69,734.00	0.25
106	000921	海信家电	2,400	69,360.00	0.25
107	300502	新易盛	600	69,348.00	0.25

108	002475	立讯精密	1,700	69,292.00	0.25
109	002138	顺络电子	2,200	69,256.00	0.25
110	000513	丽珠集团	1,800	68,400.00	0.25
111	601866	中远海发	26,100	68,121.00	0.25
112	600549	厦门钨业	3,500	67,445.00	0.25
113	601975	招商南油	21,500	67,295.00	0.24
114	600141	兴发集团	3,100	67,270.00	0.24
115	002027	分众传媒	9,500	66,785.00	0.24
116	600887	伊利股份	2,200	66,396.00	0.24
117	600029	南方航空	10,100	65,549.00	0.24
118	688779	五矿新能	12,274	65,297.68	0.24
119	002595	豪迈科技	1,300	65,247.00	0.24
120	300601	康泰生物	3,800	65,170.00	0.24
121	300529	健帆生物	2,200	64,548.00	0.23
122	688297	中无人机	1,597	64,327.16	0.23
123	688248	南网科技	1,988	63,794.92	0.23
124	601108	财通证券	7,800	63,726.00	0.23
125	002709	天赐材料	3,200	63,104.00	0.23
126	300035	中科电气	4,200	62,790.00	0.23
127	600299	安迪苏	5,000	62,750.00	0.23
128	300699	光威复材	1,800	62,370.00	0.23
129	000166	申万宏源	11,500	61,525.00	0.22
130	688375	国博电子	1,244	61,403.84	0.22
131	002865	钧达股份	1,200	61,320.00	0.22
132	300002	神州泰岳	5,200	60,268.00	0.22
133	000333	美的集团	800	60,176.00	0.22
134	601965	中国汽研	3,400	59,908.00	0.22
135	600483	福能股份	6,000	59,820.00	0.22
136	600970	中材国际	6,300	59,724.00	0.22
137	688295	中复神鹰	2,978	59,351.54	0.22
138	002153	石基信息	8,300	59,262.00	0.22
139	601899	紫金矿业	3,900	58,968.00	0.21
140	000792	盐湖股份	3,500	57,610.00	0.21
141	600521	华海药业	3,200	57,184.00	0.21
142	002517	恺英网络	4,200	57,162.00	0.21
143	300442	润泽科技	1,100	57,156.00	0.21
144	600398	海澜之家	7,600	57,000.00	0.21
145	002756	永兴材料	1,500	56,580.00	0.21
146	603160	汇顶科技	700	56,378.00	0.20
147	002518	科士达	2,500	56,325.00	0.20
148	001979	招商蛇口	5,500	56,320.00	0.20
149	002434	万里扬	9,000	55,800.00	0.20
150	600031	三一重工	3,300	54,384.00	0.20

151	688600	皖仪科技	4,000	53,800.00	0.20
152	601939	建设银行	6,100	53,619.00	0.19
153	002487	大金重工	2,600	53,274.00	0.19
154	300750	宁德时代	200	53,200.00	0.19
155	688819	天能股份	1,951	53,106.22	0.19
156	300253	卫宁健康	7,400	52,984.00	0.19
156	600339	中油工程	14,800	52,984.00	0.19
157	301236	软通动力	900	52,839.00	0.19
158	300451	创业慧康	11,700	52,416.00	0.19
159	002202	金风科技	5,000	51,650.00	0.19
160	603338	浙江鼎力	800	51,616.00	0.19
161	601168	西部矿业	3,200	51,424.00	0.19
162	300760	迈瑞医疗	200	51,000.00	0.19
163	600764	中国海防	1,800	50,976.00	0.19
164	600885	宏发股份	1,600	50,912.00	0.18
165	300146	汤臣倍健	4,200	50,610.00	0.18
166	603379	三美股份	1,300	49,894.00	0.18
167	600258	首旅酒店	3,400	49,878.00	0.18
168	601919	中远海控	3,200	49,600.00	0.18
169	301029	怡合达	2,000	49,440.00	0.18
170	300232	洲明科技	7,135	49,017.45	0.18
171	688610	埃科光电	1,408	48,857.60	0.18
172	600496	精工钢构	16,100	48,622.00	0.18
173	601399	国机重装	15,600	48,048.00	0.17
174	002429	兆驰股份	8,300	47,974.00	0.17
175	300795	米奥会展	2,300	46,023.00	0.17
176	600276	恒瑞医药	1,000	45,900.00	0.17
177	300861	美畅股份	2,300	45,885.00	0.17
178	600015	华夏银行	5,700	45,657.00	0.17
179	600699	均胜电子	2,900	45,443.00	0.17
180	000776	广发证券	2,800	45,388.00	0.16
181	000768	中航西飞	1,600	45,184.00	0.16
182	300525	博思软件	2,900	45,182.00	0.16
183	002928	华夏航空	5,800	45,008.00	0.16
184	603612	索通发展	3,300	44,583.00	0.16
185	002390	信邦制药	9,700	44,135.00	0.16
186	600977	中国电影	3,800	44,118.00	0.16
187	600968	海油发展	10,200	43,554.00	0.16
188	688519	南亚新材	2,021	42,966.46	0.16
189	300498	温氏股份	2,600	42,926.00	0.16
190	000937	冀中能源	6,700	42,344.00	0.15
191	002050	三花智控	1,800	42,318.00	0.15
192	301377	鼎泰高科	2,000	42,300.00	0.15

193	002139	拓邦股份	3,100	42,191.00	0.15
194	000733	振华科技	1,000	42,170.00	0.15
195	300457	赢合科技	2,200	42,108.00	0.15
196	002281	光迅科技	800	41,736.00	0.15
197	002340	格林美	6,300	41,139.00	0.15
198	688208	道通科技	1,049	41,078.84	0.15
199	000917	电广传媒	5,800	41,006.00	0.15
200	002698	博实股份	2,400	40,800.00	0.15
201	000401	冀东水泥	7,800	40,794.00	0.15
202	002432	九安医疗	1,000	40,780.00	0.15
203	600098	广州发展	6,300	40,446.00	0.15
204	688580	伟思医疗	1,449	40,441.59	0.15
205	000063	中兴通讯	1,000	40,400.00	0.15
206	000883	湖北能源	8,100	40,338.00	0.15
207	600704	物产中大	7,900	39,974.00	0.15
208	600063	皖维高新	9,900	39,600.00	0.14
209	601222	林洋能源	5,600	39,592.00	0.14
210	601328	交通银行	5,000	38,850.00	0.14
210	688188	柏楚电子	200	38,850.00	0.14
211	603948	建业股份	2,100	38,703.00	0.14
212	600859	王府井	2,500	38,525.00	0.14
213	600900	长江电力	1,300	38,415.00	0.14
214	002821	凯莱英	500	38,045.00	0.14
215	688271	联影医疗	300	37,920.00	0.14
216	002697	红旗连锁	6,300	37,233.00	0.14
217	603192	汇得科技	2,500	37,100.00	0.13
218	002353	杰瑞股份	1,000	36,990.00	0.13
219	603568	伟明环保	1,700	36,771.00	0.13
220	003031	中瓷电子	700	36,673.00	0.13
221	600587	新华医疗	2,190	36,463.50	0.13
222	600570	恒生电子	1,300	36,387.00	0.13
223	600325	华发股份	6,300	36,288.00	0.13
224	000021	深科技	1,900	36,214.00	0.13
225	603228	景旺电子	1,300	36,192.00	0.13
226	600008	首创环保	11,000	36,080.00	0.13
227	600166	福田汽车	14,300	35,893.00	0.13
228	002567	唐人神	7,000	35,700.00	0.13
229	688319	欧林生物	3,360	35,616.00	0.13
230	601156	东航物流	2,100	35,427.00	0.13
231	601877	正泰电器	1,500	35,115.00	0.13
232	688335	复洁环保	4,158	35,051.94	0.13
233	600489	中金黄金	2,900	34,887.00	0.13
234	601117	中国化学	4,200	34,818.00	0.13

235	002444	巨星科技	1,070	34,614.50	0.13
236	688173	希荻微	3,001	33,251.08	0.12
237	600642	申能股份	3,500	33,215.00	0.12
238	000156	华数传媒	4,600	33,120.00	0.12
239	000338	潍柴动力	2,400	32,880.00	0.12
240	600079	人福医药	1,400	32,732.00	0.12
241	300661	圣邦股份	400	32,712.00	0.12
242	600663	陆家嘴	3,300	32,472.00	0.12
243	002508	老板电器	1,500	32,145.00	0.12
244	000933	神火股份	1,900	32,110.00	0.12
245	002557	洽洽食品	1,100	31,955.00	0.12
246	603163	圣晖集成	1,200	31,884.00	0.12
247	601669	中国电建	5,800	31,668.00	0.12
248	000090	天健集团	7,700	31,647.00	0.11
249	300724	捷佳伟创	500	31,605.00	0.11
250	605099	共创草坪	1,500	31,470.00	0.11
251	002608	江苏国信	4,100	31,447.00	0.11
252	002081	金螳螂	8,800	31,416.00	0.11
253	000423	东阿阿胶	500	31,360.00	0.11
254	002967	广电计量	1,900	31,160.00	0.11
255	601390	中国中铁	4,800	30,672.00	0.11
256	605589	圣泉集团	1,300	30,654.00	0.11
257	688122	西部超导	710	30,402.20	0.11
258	600522	中天科技	2,100	30,072.00	0.11
259	600418	江淮汽车	800	30,000.00	0.11
260	002436	兴森科技	2,700	29,997.00	0.11
261	688041	海光信息	200	29,958.00	0.11
262	002385	大北农	6,900	29,877.00	0.11
263	300308	中际旭创	241	29,765.91	0.11
264	600499	科达制造	3,800	29,640.00	0.11
265	600750	江中药业	1,300	29,510.00	0.11
266	603317	天味食品	2,200	29,348.00	0.11
267	688387	信科移动	4,924	29,347.04	0.11
268	300866	安克创新	300	29,292.00	0.11
269	603993	洛阳钼业	4,400	29,260.00	0.11
270	603707	健友股份	2,200	29,194.00	0.11
271	688006	杭可科技	1,630	29,111.80	0.11
272	600037	歌华有线	3,900	29,094.00	0.11
273	002028	思源电气	400	29,080.00	0.11
274	300587	天铁科技	6,600	28,974.00	0.11
275	688798	艾为电子	412	28,765.84	0.10
276	000636	风华高科	2,000	28,700.00	0.10
277	600516	方大炭素	5,900	28,497.00	0.10

278	002594	比亚迪	100	28,266.00	0.10
279	002408	齐翔腾达	5,600	28,168.00	0.10
280	600201	生物股份	4,100	28,126.00	0.10
281	601138	工业富联	1,300	27,950.00	0.10
282	300548	博创科技	600	27,846.00	0.10
283	688220	翱捷科技	514	27,802.26	0.10
284	688612	威迈斯	1,171	27,565.34	0.10
285	603259	药明康德	500	27,520.00	0.10
286	000651	格力电器	600	27,270.00	0.10
287	301039	中集车辆	3,000	27,150.00	0.10
287	688315	诺禾致源	2,172	27,150.00	0.10
288	000630	铜陵有色	8,400	27,132.00	0.10
289	300408	三环集团	700	26,957.00	0.10
290	002714	牧原股份	700	26,908.00	0.10
291	600195	中牧股份	4,000	26,840.00	0.10
292	603596	伯特利	600	26,754.00	0.10
293	002185	华天科技	2,300	26,703.00	0.10
294	603799	华友钴业	900	26,334.00	0.10
295	688278	特宝生物	358	26,266.46	0.10
296	601958	金钼股份	2,600	26,156.00	0.10
297	688052	纳芯微	200	26,060.00	0.09
298	000988	华工科技	600	25,980.00	0.09
299	600416	湘电股份	2,300	25,967.00	0.09
300	002832	比音勒芬	1,200	25,692.00	0.09
301	601702	华峰铝业	1,400	25,648.00	0.09
302	688475	萤石网络	848	25,601.12	0.09
303	002223	鱼跃医疗	700	25,543.00	0.09
304	301297	富乐德	600	25,500.00	0.09
305	300251	光线传媒	2,700	25,488.00	0.09
306	002372	伟星新材	2,000	25,260.00	0.09
307	600019	宝钢股份	3,600	25,200.00	0.09
308	603868	飞科电器	600	24,912.00	0.09
309	002080	中材科技	1,900	24,852.00	0.09
310	688777	中控技术	499	24,785.33	0.09
311	300773	拉卡拉	1,400	24,780.00	0.09
312	300763	锦浪科技	400	24,428.00	0.09
313	002373	千方科技	2,400	24,336.00	0.09
314	688065	凯赛生物	627	24,327.60	0.09
315	601990	南京证券	2,800	24,248.00	0.09
316	002100	天康生物	3,700	24,235.00	0.09
317	000629	钒钛股份	8,400	24,192.00	0.09
318	603218	日月股份	2,000	24,100.00	0.09
319	601615	明阳智能	1,900	23,959.00	0.09

320	300015	爱尔眼科	1,800	23,850.00	0.09
321	600062	华润双鹤	1,200	23,760.00	0.09
322	600350	山东高速	2,300	23,644.00	0.09
323	300012	华测检测	1,900	23,617.00	0.09
324	300979	华利集团	300	23,595.00	0.09
325	000550	江铃汽车	1,000	23,450.00	0.09
326	603225	新凤鸣	2,100	23,373.00	0.08
327	300014	亿纬锂能	500	23,370.00	0.08
328	000066	中国长城	1,600	23,312.00	0.08
329	603456	九洲药业	1,700	23,256.00	0.08
330	002867	周大生	1,600	23,248.00	0.08
331	000983	山西焦煤	2,800	23,072.00	0.08
332	002739	万达电影	1,900	23,066.00	0.08
333	603181	皇马科技	2,000	23,060.00	0.08
334	603288	海天味业	500	22,950.00	0.08
335	601868	中国能建	10,000	22,900.00	0.08
336	600331	宏达股份	3,000	22,860.00	0.08
337	601997	贵阳银行	3,800	22,800.00	0.08
338	601228	广州港	6,700	22,713.00	0.08
339	002180	纳思达	800	22,536.00	0.08
340	003012	东鹏控股	3,400	22,474.00	0.08
341	000155	川能动力	2,100	22,428.00	0.08
342	002068	黑猫股份	2,100	22,344.00	0.08
343	688599	天合光能	1,157	22,330.10	0.08
344	601568	北元集团	5,300	22,260.00	0.08
345	600129	太极集团	900	22,248.00	0.08
346	003035	南网能源	5,300	22,154.00	0.08
347	600598	北大荒	1,500	22,125.00	0.08
348	603893	瑞芯微	200	22,012.00	0.08
349	600271	航天信息	2,400	21,864.00	0.08
350	300373	扬杰科技	500	21,760.00	0.08
351	002299	圣农发展	1,500	21,720.00	0.08
352	600298	安琪酵母	600	21,630.00	0.08
353	600115	中国东航	5,400	21,600.00	0.08
354	603298	杭叉集团	1,200	21,468.00	0.08
355	600032	浙江新能	2,900	21,460.00	0.08
356	601598	中国外运	4,000	21,400.00	0.08
357	603986	兆易创新	200	21,360.00	0.08
358	002064	华峰化学	2,600	21,268.00	0.08
359	601665	齐鲁银行	3,800	21,242.00	0.08
360	600655	豫园股份	3,300	21,219.00	0.08
361	000739	普洛药业	1,300	21,138.00	0.08
362	000039	中集集团	2,700	20,979.00	0.08

363	688200	华峰测控	200	20,900.00	0.08
364	600131	国网信通	1,100	20,801.00	0.08
365	603939	益丰药房	860	20,751.80	0.08
366	601158	重庆水务	4,200	20,580.00	0.07
367	000932	华菱钢铁	4,900	20,482.00	0.07
368	300285	国瓷材料	1,200	20,448.00	0.07
369	688266	泽璟制药	328	20,437.68	0.07
370	600584	长电科技	500	20,430.00	0.07
371	600170	上海建工	7,700	20,405.00	0.07
372	000967	盈峰环境	4,100	20,377.00	0.07
373	600995	南网储能	2,000	20,240.00	0.07
374	688516	奥特维	467	20,225.77	0.07
375	600862	中航高科	800	20,208.00	0.07
375	600989	宝丰能源	1,200	20,208.00	0.07
376	600848	上海临港	2,000	20,200.00	0.07
377	300482	万孚生物	900	20,169.00	0.07
378	300369	绿盟科技	2,800	20,132.00	0.07
379	000683	远兴能源	3,600	20,124.00	0.07
380	300394	天孚通信	220	20,099.20	0.07
381	002463	沪电股份	500	19,825.00	0.07
382	600872	中炬高新	900	19,818.00	0.07
383	605358	立昂微	800	19,816.00	0.07
384	601111	中国国航	2,500	19,775.00	0.07
385	688273	麦澜德	845	19,747.65	0.07
386	002895	川恒股份	800	19,680.00	0.07
387	600803	新奥股份	900	19,512.00	0.07
388	001286	陕西能源	2,100	19,488.00	0.07
389	002230	科大讯飞	400	19,328.00	0.07
390	601677	明泰铝业	1,600	19,248.00	0.07
391	600320	振华重工	4,900	19,208.00	0.07
392	600999	招商证券	1,000	19,160.00	0.07
393	600025	华能水电	2,000	19,020.00	0.07
394	600132	重庆啤酒	300	18,906.00	0.07
395	600373	中文传媒	1,500	18,825.00	0.07
396	601618	中国中冶	5,700	18,810.00	0.07
397	600059	古越龙山	2,100	18,648.00	0.07
398	601225	陕西煤业	800	18,608.00	0.07
399	688536	思瑞浦	200	18,500.00	0.07
400	300286	安科瑞	900	18,495.00	0.07
401	688561	奇安信	686	18,405.38	0.07
402	603337	杰克股份	600	18,276.00	0.07
403	002938	鹏鼎控股	500	18,240.00	0.07
404	000425	徐工机械	2,300	18,239.00	0.07

405	002609	捷顺科技	2,200	18,172.00	0.07
406	600500	中化国际	4,500	18,090.00	0.07
407	002241	歌尔股份	700	18,067.00	0.07
408	688232	新点软件	622	18,031.78	0.07
409	688141	杰华特	589	18,029.29	0.07
410	000913	钱江摩托	1,000	18,010.00	0.07
411	603730	岱美股份	2,000	17,980.00	0.07
412	601636	旗滨集团	3,200	17,952.00	0.07
413	002088	鲁阳节能	1,400	17,906.00	0.07
414	603279	景津装备	1,000	17,880.00	0.06
415	603888	新华网	800	17,872.00	0.06
416	002174	游族网络	1,900	17,765.00	0.06
417	603466	风语筑	1,900	17,708.00	0.06
418	600236	桂冠电力	2,600	17,680.00	0.06
419	600406	国电南瑞	700	17,654.00	0.06
420	000032	深桑达 A	1,000	17,640.00	0.06
421	605098	行动教育	500	17,620.00	0.06
422	601766	中国中车	2,100	17,598.00	0.06
423	300124	汇川技术	300	17,574.00	0.06
424	002465	海格通信	1,600	17,568.00	0.06
425	605060	联德股份	1,000	17,470.00	0.06
426	603871	嘉友国际	900	17,415.00	0.06
427	000543	皖能电力	2,200	17,402.00	0.06
428	600223	福瑞达	2,300	17,388.00	0.06
429	600361	创新新材	4,500	17,370.00	0.06
430	000963	华东医药	500	17,300.00	0.06
431	603583	捷昌驱动	700	17,297.00	0.06
432	002011	盾安环境	1,600	17,296.00	0.06
433	600161	天坛生物	840	17,220.00	0.06
434	000591	太阳能	3,600	17,136.00	0.06
434	600018	上港集团	2,800	17,136.00	0.06
435	601666	平煤股份	1,700	17,034.00	0.06
436	300777	中简科技	600	16,974.00	0.06
437	000902	新洋丰	1,300	16,952.00	0.06
438	688187	时代电气	353	16,915.76	0.06
439	600428	中远海特	2,300	16,790.00	0.06
440	600821	金开新能	3,100	16,740.00	0.06
441	002158	汉钟精机	900	16,668.00	0.06
442	002653	海思科	500	16,625.00	0.06
443	603989	艾华集团	1,100	16,588.00	0.06
444	603816	顾家家居	600	16,548.00	0.06
445	688180	君实生物	605	16,534.65	0.06
446	002705	新宝股份	1,100	16,500.00	0.06

447	688665	四方光电	506	16,490.54	0.06
448	300416	苏试试验	1,400	16,464.00	0.06
449	002818	富森美	1,100	16,434.00	0.06
450	688257	新锐股份	902	16,425.42	0.06
451	002690	美亚光电	1,100	16,302.00	0.06
452	002948	青岛银行	4,200	16,296.00	0.06
453	601456	国联民生	1,200	16,224.00	0.06
454	688548	广钢气体	1,609	16,202.63	0.06
455	000048	京基智农	900	16,200.00	0.06
455	603365	水星家纺	1,000	16,200.00	0.06
456	300688	创业黑马	500	16,005.00	0.06
457	000708	中信特钢	1,400	15,974.00	0.06
458	300316	晶盛机电	500	15,950.00	0.06
459	601699	潞安环能	1,100	15,796.00	0.06
460	688147	微导纳米	587	15,784.43	0.06
461	600814	杭州解百	1,900	15,751.00	0.06
461	601311	骆驼股份	1,900	15,751.00	0.06
462	605006	山东玻纤	2,500	15,725.00	0.06
463	603699	纽威股份	700	15,519.00	0.06
464	300458	全志科技	400	15,504.00	0.06
465	002096	易普力	1,300	15,444.00	0.06
466	000960	锡业股份	1,100	15,433.00	0.06
467	000012	南玻A	2,900	15,312.00	0.06
468	300982	苏文电能	800	15,288.00	0.06
469	601319	中国人保	2,000	15,240.00	0.06
470	002152	广电运通	1,300	15,158.00	0.06
471	688581	安杰思	251	14,982.19	0.05
472	688191	智洋创新	877	14,926.54	0.05
473	603997	继峰股份	1,300	14,885.00	0.05
474	002841	视源股份	400	14,764.00	0.05
475	601333	广深铁路	4,300	14,749.00	0.05
476	601689	拓普集团	300	14,700.00	0.05
477	300633	开立医疗	500	14,695.00	0.05
478	600482	中国动力	600	14,682.00	0.05
479	300682	朗新集团	1,200	14,640.00	0.05
480	300593	新雷能	1,300	14,560.00	0.05
481	002859	洁美科技	700	14,525.00	0.05
482	603806	福斯特	980	14,504.00	0.05
483	688677	海泰新光	385	14,499.10	0.05
484	300919	中伟股份	400	14,448.00	0.05
485	688526	科前生物	1,011	14,447.19	0.05
486	601966	玲珑轮胎	800	14,432.00	0.05
487	600150	中国船舶	400	14,384.00	0.05

488	601858	中国科传	700	14,266.00	0.05
489	601921	浙版传媒	1,800	14,184.00	0.05
490	688156	路德环境	1,046	14,152.38	0.05
491	688357	建龙微纳	642	14,079.06	0.05
492	600661	昂立教育	1,200	14,064.00	0.05
493	688310	迈得医疗	1,297	14,007.60	0.05
494	002568	百润股份	500	14,005.00	0.05
495	300860	锋尚文化	500	13,915.00	0.05
496	300263	隆华科技	1,900	13,870.00	0.05
497	600986	浙文互联	2,300	13,754.00	0.05
498	002252	上海莱士	1,900	13,718.00	0.05
499	600662	外服控股	2,700	13,689.00	0.05
500	600009	上海机场	400	13,660.00	0.05
501	601126	四方股份	800	13,568.00	0.05
502	688029	南微医学	200	13,518.00	0.05
503	605268	王力安防	1,600	13,440.00	0.05
504	601127	赛力斯	100	13,339.00	0.05
505	603087	甘李药业	300	13,230.00	0.05
506	002466	天齐锂业	400	13,200.00	0.05
507	002060	广东建工	3,600	13,176.00	0.05
508	000035	中国天楹	2,700	13,149.00	0.05
509	000617	中油资本	1,900	13,091.00	0.05
510	600335	国机汽车	2,100	13,083.00	0.05
511	002065	东华软件	1,800	13,068.00	0.05
512	600125	铁龙物流	2,200	13,046.00	0.05
513	601088	中国神华	300	13,044.00	0.05
514	688179	阿拉丁	937	12,930.60	0.05
515	300759	康龙化成	500	12,850.00	0.05
516	600888	新疆众和	1,800	12,780.00	0.05
517	688570	天玛智控	662	12,717.02	0.05
518	000568	泸州老窖	101	12,645.20	0.05
519	688055	龙腾光电	3,058	12,629.54	0.05
520	000910	大亚圣象	1,600	12,592.00	0.05
521	688293	奥浦迈	344	12,549.12	0.05
522	688131	皓元医药	351	12,530.70	0.05
523	605500	森林包装	1,800	12,528.00	0.05
524	688586	江航装备	1,308	12,517.56	0.05
525	688105	诺唯赞	560	12,415.20	0.05
526	688069	德林海	825	12,391.50	0.05
527	688178	万德斯	987	12,327.63	0.04
528	301559	中集环科	800	12,280.00	0.04
529	688177	百奥泰	627	12,151.26	0.04
530	600330	天通股份	1,700	12,070.00	0.04

531	603017	中衡设计	1,500	12,045.00	0.04
532	000997	新大陆	600	11,970.00	0.04
533	600563	法拉电子	100	11,892.00	0.04
534	300781	因赛集团	200	11,806.00	0.04
535	688372	伟测科技	200	11,704.00	0.04
536	600985	淮北矿业	816	11,481.12	0.04
537	600739	辽宁成大	1,100	11,385.00	0.04
538	002240	盛新锂能	800	11,024.00	0.04
539	002884	凌霄泵业	600	10,962.00	0.04
540	002043	兔宝宝	900	10,692.00	0.04
541	600906	财达证券	1,500	10,650.00	0.04
541	603109	神驰机电	600	10,650.00	0.04
542	301031	中熔电气	100	10,402.00	0.04
543	000977	浪潮信息	200	10,376.00	0.04
544	001872	招商港口	500	10,235.00	0.04
545	000537	中绿电	1,100	10,032.00	0.04
546	002249	大洋电机	1,700	9,979.00	0.04
547	601336	新华保险	200	9,940.00	0.04
548	002850	科达利	100	9,768.00	0.04
549	603983	丸美生物	300	9,678.00	0.04
550	002019	亿帆医药	900	9,648.00	0.04
551	688099	晶晨股份	140	9,615.20	0.03
552	002970	锐明技术	200	9,526.00	0.03
553	002906	华阳集团	301	9,255.75	0.03
554	605599	菜百股份	800	9,080.00	0.03
555	300684	中石科技	400	8,972.00	0.03
556	000878	云南铜业	700	8,533.00	0.03
557	600801	华新水泥	700	8,470.00	0.03
558	600158	中体产业	1,000	8,270.00	0.03
559	688213	思特威	104	8,082.88	0.03
560	600415	小商品城	600	8,046.00	0.03
561	600873	梅花生物	800	8,024.00	0.03
562	300059	东方财富	300	7,746.00	0.03
563	300628	亿联网络	200	7,720.00	0.03
564	002912	中新赛克	300	7,677.00	0.03
565	600377	宁沪高速	500	7,655.00	0.03
566	605499	东鹏饮料	30	7,455.60	0.03
567	300783	三只松鼠	200	7,374.00	0.03
568	300986	志特新材	600	7,284.00	0.03
569	688596	正帆科技	201	7,145.55	0.03
570	002891	中宠股份	200	7,140.00	0.03
571	600309	万华化学	100	7,135.00	0.03
572	600546	山煤国际	600	7,098.00	0.03

573	603195	公牛集团	100	7,024.00	0.03
574	688096	京源环保	929	6,930.34	0.03
575	600310	广西能源	1,500	6,840.00	0.02
576	601601	中国太保	200	6,816.00	0.02
577	688312	燕麦科技	220	6,776.00	0.02
578	601888	中国中免	100	6,701.00	0.02
579	601696	中银证券	600	6,696.00	0.02
580	001206	依依股份	400	6,612.00	0.02
581	603517	绝味食品	400	6,576.00	0.02
582	600316	洪都航空	200	6,424.00	0.02
583	600633	浙数文化	600	6,276.00	0.02
584	002415	海康威视	200	6,140.00	0.02
585	603678	火炬电子	200	6,100.00	0.02
586	600486	扬农化工	100	5,787.00	0.02
587	300595	欧普康视	300	5,685.00	0.02
588	603605	珀莱雅	66	5,590.20	0.02
589	600021	上海电力	600	5,502.00	0.02
590	600754	锦江酒店	200	5,372.00	0.02
591	002683	广东宏大	200	5,296.00	0.02
592	002120	韵达股份	700	5,264.00	0.02
593	600863	内蒙华电	1,200	5,196.00	0.02
594	002271	东方雨虹	400	5,192.00	0.02
595	601825	沪农商行	600	5,106.00	0.02
596	600435	北方导航	500	4,880.00	0.02
597	002262	恩华药业	200	4,870.00	0.02
598	002025	航天电器	100	4,856.00	0.02
599	603486	科沃斯	100	4,700.00	0.02
600	601128	常熟银行	610	4,617.70	0.02
601	603179	新泉股份	100	4,270.00	0.02
602	300676	华大基因	100	4,197.00	0.02
603	601628	中国人寿	100	4,192.00	0.02
604	600765	中航重机	200	4,094.00	0.01
605	600036	招商银行	100	3,930.00	0.01
606	600498	烽火通信	200	3,892.00	0.01
607	000898	鞍钢股份	1,600	3,840.00	0.01
608	300395	菲利华	100	3,761.00	0.01
609	300037	新宙邦	100	3,744.00	0.01
610	002261	拓维信息	200	3,662.00	0.01
611	603055	台华新材	300	3,324.00	0.01
612	600329	达仁堂	100	3,080.00	0.01
613	603737	三棵树	68	2,896.80	0.01
614	600348	华阳股份	400	2,836.00	0.01
615	003022	联泓新科	200	2,754.00	0.01

616	002936	郑州银行	1,300	2,730.00	0.01
617	601118	海南橡胶	500	2,705.00	0.01
618	600268	国电南自	400	2,688.00	0.01
619	600551	时代出版	300	2,583.00	0.01
620	002876	三利谱	100	2,566.00	0.01
621	000703	恒逸石化	400	2,512.00	0.01
622	601898	中煤能源	200	2,436.00	0.01
623	600160	巨化股份	100	2,412.00	0.01
624	600685	中船防务	100	2,370.00	0.01
625	600547	山东黄金	100	2,263.00	0.01
626	301322	绿通科技	100	2,198.00	0.01
627	002544	普天科技	100	2,143.00	0.01
628	600562	国睿科技	100	1,993.00	0.01
629	603712	七一二	100	1,947.00	0.01
630	603826	坤彩科技	100	1,925.00	0.01
631	600580	卧龙电驱	100	1,719.00	0.01
632	600315	上海家化	100	1,691.00	0.01
633	603185	弘元绿能	100	1,625.00	0.01
634	603885	吉祥航空	100	1,370.00	0.00
635	002410	广联达	100	1,176.00	0.00
636	600588	用友网络	100	1,073.00	0.00
637	601229	上海银行	100	915.00	0.00
638	600879	航天电子	100	896.00	0.00
639	600048	保利发展	100	886.00	0.00
640	601918	新集能源	100	718.00	0.00
641	600011	华能国际	100	677.00	0.00
642	600582	天地科技	100	618.00	0.00
643	600909	华安证券	100	606.00	0.00
644	600023	浙能电力	100	566.00	0.00
645	688082	盛美上海	5	500.00	0.00
646	603127	昭衍新药	20	332.60	0.00
647	601828	美凯龙	100	321.00	0.00
648	603328	依顿电子	23	226.78	0.00
649	688009	中国通号	29	181.54	0.00
650	688363	华熙生物	3	153.12	0.00
651	688498	源杰科技	1	134.20	0.00
652	688513	苑东生物	3	90.39	0.00
653	688305	科德数控	1	68.17	0.00
654	688521	芯原股份	1	52.43	0.00
655	688234	天岳先进	1	51.20	0.00
656	002985	北摩高科	2	47.00	0.00
657	688778	厦钨新能	1	45.64	0.00
658	688100	威胜信息	1	36.20	0.00

659	688166	博瑞医药	1	30.20	0.00
660	688010	福光股份	1	28.50	0.00
661	300925	法本信息	1	22.28	0.00
662	688369	致远互联	1	20.07	0.00
663	300752	隆利科技	1	17.00	0.00
664	688355	明志科技	1	16.75	0.00
665	300398	飞凯材料	1	15.76	0.00
666	688678	福立旺	1	14.85	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	667,648.00	1.80
2	601939	建设银行	445,943.00	1.20
3	600276	恒瑞医药	438,045.00	1.18
4	601717	郑煤机	420,658.00	1.13
5	600060	海信视像	404,386.00	1.09
6	300803	指南针	399,661.00	1.07
7	601899	紫金矿业	398,863.00	1.07
8	601991	大唐发电	397,125.00	1.07
9	002422	科伦药业	388,844.00	1.05
10	002463	沪电股份	380,729.00	1.02
11	000858	五粮液	379,420.00	1.02
12	002532	天山铝业	375,910.00	1.01
13	601600	中国铝业	373,583.00	1.00
14	002273	水晶光电	367,385.00	0.99
15	300017	网宿科技	362,472.00	0.97
16	002558	巨人网络	360,239.00	0.97
17	300474	景嘉微	347,420.00	0.93
18	000975	山金国际	342,590.00	0.92
19	000156	华数传媒	339,692.00	0.91
20	002384	东山精密	335,296.00	0.90

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	555,266.00	1.49
2	002422	科伦药业	498,316.00	1.34
3	601939	建设银行	436,767.00	1.17
4	600276	恒瑞医药	422,491.00	1.14

5	601857	中国石油	419,496.00	1.13
6	601898	中煤能源	419,343.00	1.13
7	600161	天坛生物	416,578.00	1.12
8	002463	沪电股份	401,583.00	1.08
9	601600	中国铝业	397,832.00	1.07
10	000156	华数传媒	394,811.00	1.06
11	000975	山金国际	388,860.00	1.05
12	600066	宇通客车	385,403.00	1.04
13	601168	西部矿业	373,852.00	1.01
14	600418	江淮汽车	372,148.00	1.00
15	002532	天山铝业	357,264.00	0.96
16	600028	中国石化	355,167.00	0.96
17	601899	紫金矿业	353,497.00	0.95
18	000039	中集集团	352,916.00	0.95
19	000858	五粮液	344,589.00	0.93
20	601728	中国电信	341,978.00	0.92

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	129,243,732.44
卖出股票收入（成交）总额	130,567,259.08

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,443.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,404.08
6	其他应收款	653.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,500.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	209	84,128.74	15,653,463.00	89.03	1,929,443.24	10.97
银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	484	1,613.73	-	-	781,046.82	100.00
合计	693	26,499.21	15,653,463.00	85.24	2,710,490.06	14.76

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	366,535.59	2.08
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	30,133.39	3.86
	合计	396,668.98	2.16

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,400.14	54.46	10,001,400.14	54.46	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	54.46	10,001,400.14	54.46	3年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日 (2017年12月15日)基金份额总额	13,175,905.27	1,086,315.48
本报告期期初基金份额总额	17,993,920.11	9,398,602.58
本报告期基金总申购份额	418,197.83	5,065,039.37
减：本报告期基金总赎回份额	829,211.70	13,682,595.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,582,906.24	781,046.82

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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 6,229.51 元。该审计机构已经为本基金连续提供了 7 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方财富	5	160,004,465.68	61.58	39,343.56	46.92	撤销 2 个交易单元
国泰君安	3	24,558,269.70	9.45	10,951.05	13.06	-
浙商证券	2	22,434,554.47	8.63	10,004.02	11.93	-
信达证券	1	17,603,720.33	6.78	7,850.63	9.36	-
西部证券	1	13,004,037.08	5.01	5,797.86	6.91	撤销 1 个交易单元
开源证券	2	11,804,048.26	4.54	5,263.79	6.28	-
国联证券	1	10,401,896.00	4.00	4,638.17	5.53	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	撤销 2个 交易 单元
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	3	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	撤销 2个 交易 单元
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司参与证券交易的标准为：（1）具备为公募基金提供交易服务、研究服务所需的业务资格。（2）财务状况良好，经营行为规范。（3）建立并具有健全的合规风控制度。（4）具有较强的交易服务能力、研究服务能力。

2、公司将参与证券交易的合作券商分为普通合作券商和重点合作券商两类。其中，普通合作券商应具备较强的交易服务能力；重点合作券商除需满足具备较强的交易服务能力要求外，还需具备较强的研究服务能力。

3、符合以上标准的证券公司可向公司提出准入申请，并按要求提交相关材料。公司对证券公司提交的材料依次开展初审评估、评审会评审及公司领导审批，通过评审及审批的证券公司方可获得证券交易参与资格。

4、本基金管理人严格落实《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，2024年6月30日前完成股票交易佣金费率的调整。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东方财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证	-	-	-	-	-	-

券						
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金 2023 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	2024 年 1 月 19 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 1 月 19 日
3	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金 2023 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	2024 年 3 月 29 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 3 月 29 日
5	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金 2024 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	2024 年 4 月 19 日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 4 月 19 日
7	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日
8	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 18 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 7 月 18 日
10	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 26 日
11	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金招募说明书更新 (2024 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	2024 年 7 月 26 日

12	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金 2024 年中期报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 31 日
13	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 8 月 31 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金基金经理离任的公告》	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	2024 年 9 月 28 日
15	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金招募说明书更新 (2024 年第 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 9 月 30 日
16	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 9 月 30 日
17	《银华稳健增利灵活配置混合发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 24 日
18	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 10 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20241231	10,001,400.14	0.00	0.00	10,001,400.14	54.46
	2	20240101-20241231	5,652,062.86	0.00	0.00	5,652,062.86	30.78

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额

净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.1.2 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》

13.1.3 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

13.1.4 《银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2025 年 3 月 28 日