

银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券
投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20
6.3 净资产变动表	22
6.4 报表附注	24
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	63

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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 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	18,593,610.82 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	17,613,301.52 份	980,309.30 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
本期已实现收益	365,999.90	27,143.70
本期利润	-807,797.91	45,306.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0455	0.0284
本期加权平均净值利润率	-3.36%	2.13%
本期基金份额净	-3.35%	-3.58%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	5,646,767.21	286,755.45
期末可供分配基金份额利润	0.3206	0.2925
期末基金资产净值	23,260,068.73	1,267,064.75
期末基金份额净值	1.3206	1.2925
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	32.06%	29.25%

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
过去一个月	-5.18%	0.77%	-1.77%	0.28%	-3.41%	0.49%
过去三个月	-4.64%	0.94%	-1.11%	0.40%	-3.53%	0.54%
过去六个月	-3.35%	1.31%	0.39%	0.50%	-3.74%	0.81%
过去一年	-13.06%	1.07%	-4.49%	0.46%	-8.57%	0.61%
过去三年	-21.71%	1.10%	-14.38%	0.51%	-7.33%	0.59%
自基金合同生效起至今	32.06%	1.17%	0.93%	0.59%	31.13%	0.58%

银华稳健增利灵活配置混合发起式 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

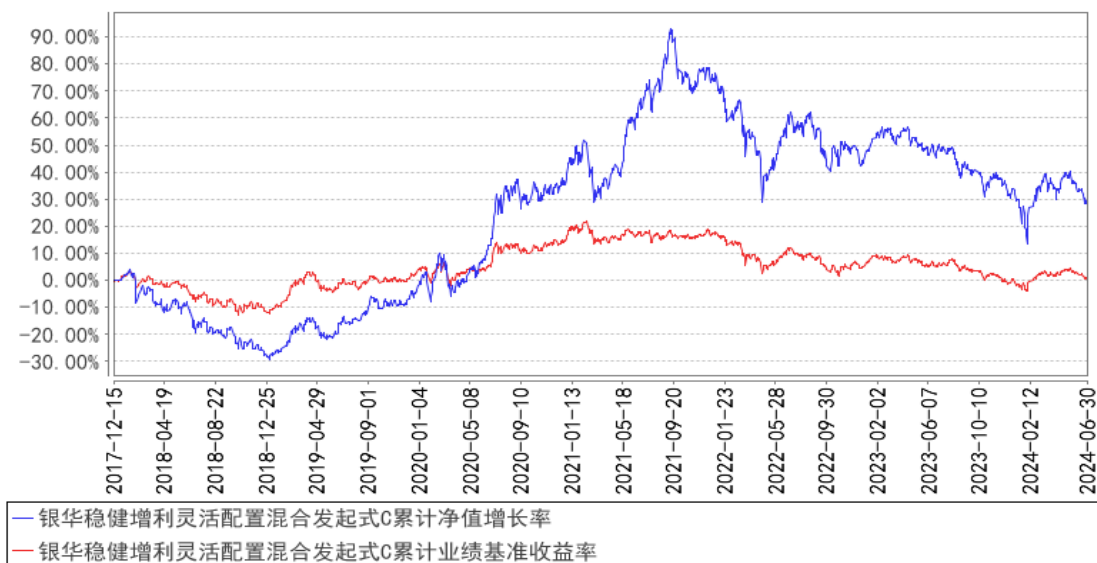
	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-5.21%	0.77%	-1.77%	0.28%	-3.44%	0.49%
过去三个月	-4.77%	0.94%	-1.11%	0.40%	-3.66%	0.54%
过去六个月	-3.58%	1.31%	0.39%	0.50%	-3.97%	0.81%
过去一年	-13.44%	1.07%	-4.49%	0.46%	-8.95%	0.61%
过去三年	-22.58%	1.10%	-14.38%	0.51%	-8.20%	0.59%
自基金合同生效起至今	29.25%	1.17%	0.93%	0.59%	28.32%	0.58%

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。

§ 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]17 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 214 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、

银华领先策略混合型证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投资基金(LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精

选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华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、银华顺和债券型证券投资基金、银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华医

疗健康混合型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华月月享 30 天持有期债券型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华惠享三年定期开放混合型证券投资基金、银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金、银华致淳债券型证券投资基金、银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、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联接基金、银华新材料混合型发起式证券投资基金、银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、银华晶鑫债券型证券投资基金、银华安泰债券型证券投资基金、银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金、银华中债 0-5 年政策性金融债指数证券投资基金、银华盛泓债券型证券投资基金、银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金、银华钰祥债券型证券投资基金、银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金、银华季季鑫 90 天持有期债券型证券投资基金、银华富兴央企 6 个月封闭运作混合型发起式证券投资基金、银华月月鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、银华恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金、银华嘉选平衡混合型发起式证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马君女士	本基金的基金经理	2017 年 12 月 15 日	-	15.5 年	硕士学位。2008 年 7 月至 2009 年 3 月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自 2012 年 9 月 4 日至 2020 年 11 月 30 日担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013 年 12 月 16 日至 2015 年 7 月 16 日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 6 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 12 月 10 日兼任银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自

				<p>2017 年 11 月 9 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日起兼任银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 15 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 11 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日至 2022 年 8 月 9 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 12 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 20 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 3 月 15 日起兼任银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）基金经理，自 2023 年 3 月 17 日起兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2023 年 9 月 6 日起兼任银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自</p>
--	--	--	--	---

					<p>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。具有从业资格。国籍: 中国。</p>
张凯先生	本基金的基金经理	2021 年 9 月 28 日	-	14.5 年	<p>硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加入银华基金,历任量化投资部金融工程助理分析师、基金经理助理、总监助理,现任量化投资部副总监、基金经理。自 2012 年 11 月 14 日至 2020 年 11 月 25 日担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理,自 2013 年 11 月 5 日至 2019 年 9 月 26 日兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金经理,自 2016 年 1 月 14 日至 2018 年 4 月 2 日兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理,自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华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</p>

					<p>29 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 9 月 22 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 9 月 28 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自 2021 年 11 月 19 日起兼任银华华证 ESG 领先指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 12 月 20 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 1 月 27 日至 2023 年 7 月 28 日兼任银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2022 年 3 月 7 日至 2023 年 9 月 8 日兼任银华中证港股通医药卫生综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。</p>
杨腾先生	本基金的基金经理	2021 年 11 月 29 日	-	11.5 年	<p>硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。2015 年 7 月加入银华基金,历任量化投资部量化研究员,量化投资部基金经理助理,现任量化投资部基金经理。自 2021 年 11 月 29 日起担任银华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金(LOF)、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华中证等权重 90 指数证券投资基金(LOF)基金经理,自 2021 年 11 月 29 日至 2023 年 3 月 16 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。</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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

上半年中,宏观经济运行整体上呈现一季度上行、二季度小幅回落的节奏。对比一、二季度的经济表现,我们能够看到一些与往年不同的特征:节假日消费与经济活动恢复良好,而非节假日期间的淡季特征则较为明显。这些特征显示出一些新的信息:从周期角度,商务活动的复苏落后于整体水平;而从更长远视角来看,伴随一系列结构性的变化,中国经济的消费属性权重正在增加。海外方面,美联储降息周期比预期有所推迟,海外利率水平依旧在高位维持。在上述因素的作用下,A股市场各主要宽基指数在上半年中涨跌互现。行业层面,银行、煤炭、石油石化等行业表现领先,消费者服务、计算机、商贸零售等行业表现落后。

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 1.3206 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.35%；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 1.2925 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.58%；业绩比较基准收益率为 0.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生，我们正处于这样的进程中，新的产业链条正在逐渐取代旧产业，成为国民经济的主体支柱。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。未来一段时期，宏观政策、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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金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 6 月 30 日。本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,440,584.44	2,139,490.04
结算备付金		170,135.62	115,523.78
存出保证金		2,736.95	2,148.02
交易性金融资产	6.4.7.2	21,970,885.80	24,015,734.32
其中：股票投资		21,970,885.80	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,215.60	11,006,199.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	65.00	-
资产总计		24,585,623.41	37,279,095.95
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	59.29
应付赎回款		1,156.57	6,244.40
应付管理人报酬		12,387.28	13,753.34
应付托管费		3,096.83	3,438.33
应付销售服务费		378.19	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	6.4.7.9	41,471.06	68,283.60
负债合计		58,489.93	92,481.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	18,593,610.82	27,392,522.69
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,933,522.66	9,794,092.20
净资产合计		24,527,133.48	37,186,614.89
负债和净资产总计		24,585,623.41	37,279,095.95

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日,基金份额总额 18,593,610.82 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 17,613,301.52 份，基金份额净值 1.3206 元。银华稳健增利灵活配置混合发起式 C 基金份额总额 980,309.30 份，基金份额净值 1.2925 元。

6.2 利润表

会计主体：银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		-641,478.71	1,577,330.11
1.利息收入		6,319.95	6,178.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,319.95	6,178.18
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）		420,327.14	175,609.07
其中：股票投资收益	6.4.7.14	145,623.27	-205,774.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	1,482.41
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	274,703.87	379,900.98
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,155,635.49	1,256,509.31
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	87,509.69	139,033.55
减：二、营业总支出		121,013.18	148,406.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	78,123.88	96,654.39
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,530.95	24,163.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,697.36	4,253.99
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		-	-

8. 其他费用	6.4.7.23	19,660.99	23,334.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-762,491.89	1,428,923.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-762,491.89	1,428,923.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-762,491.89	1,428,923.83

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	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）	-8,798,911.87	-	-3,860,569.54	-12,659,481.41
（一）、综合收益总额	-	-	-762,491.89	-762,491.89
（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）	-8,798,911.87	-	-3,098,077.65	-11,896,989.52
其中：1.基金申购款	5,066,361.51	-	1,680,428.25	6,746,789.76
2.基金赎回款	-13,865,273.38	-	-4,778,505.90	-18,643,779.28
（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	18,593,610.82	-	5,933,522.66	24,527,133.48
项目	上年度可比期间 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	37,355,856.04	-	17,011,123.18	54,366,979.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	37,355,856.04	-	17,011,123.18	54,366,979.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,966,015.85	-	-5,953,640.70	-21,919,656.55
（一）、综合收益总额	-	-	1,428,923.83	1,428,923.83
（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）	-15,966,015.85	-	-7,382,564.53	-23,348,580.38
其中：1.基金申购款	2,368,588.08	-	1,235,894.49	3,604,482.57
2.基金赎回款	-18,334,603.93	-	-8,618,459.02	-26,953,062.95
（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	21,389,840.19	-	11,057,482.48	32,447,322.67
-----------	---------------	---	---------------	---------------

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：

<u>王立新</u>	<u>凌宇翔</u>	<u>伍军辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》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

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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

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

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,440,584.44
等于：本金	2,440,356.67
加：应计利息	227.77
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,440,584.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	23,342,354.37	-	21,970,885.80	-1,371,468.57
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	23,342,354.37	-	21,970,885.80	-1,371,468.57

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

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	65.00
待摊费用	-
合计	65.00

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	22,782.66
其中：交易所市场	22,782.66
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	18,688.40
合计	41,471.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	71,667.65	71,667.65
本期赎回（以“-”号填列）	-452,286.24	-452,286.24
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	17,613,301.52	17,613,301.52

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 6 月 30 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	4,994,693.86	4,994,693.86
本期赎回（以“-”号填列）	-13,412,987.14	-13,412,987.14
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	980,309.30	980,309.30

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

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

银华稳健增利灵活配置混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
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	365,999.90	-1,173,797.81	-807,797.91
本期基金份额交易产生的变动数	-229,832.26	90,627.06	-139,205.20
其中：基金申购款	41,483.89	-15,514.49	25,969.40
基金赎回款	-271,316.15	106,141.55	-165,174.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,901,344.12	-5,254,576.91	5,646,767.21

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	27,143.70	18,162.32	45,306.02
本期基金份额交易产生的变动数	-4,804,449.07	1,845,576.62	-2,958,872.45
其中：基金申购款	2,658,042.59	-1,003,583.74	1,654,458.85
基金赎回款	-7,462,491.66	2,849,160.36	-4,613,331.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	574,973.50	-288,218.05	286,755.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	5,408.21
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	893.33
其他	18.41
合计	6,319.95

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	145,623.27
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	145,623.27

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	80,646,907.21
减：卖出股票成本总额	80,411,268.50
减：交易费用	90,015.44
买卖股票差价收入	145,623.27

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**

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	274,703.87
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	274,703.87

6.4.7.20 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6月30日
1.交易性金融资产	-1,155,635.49
股票投资	-1,155,635.49
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	-1,155,635.49

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	87,395.17
基金转换费收入	114.52
合计	87,509.69

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	18,688.40
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	972.59
合计	19,660.99

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
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

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

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

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	78,123.88	96,654.39
其中：应支付销售机构的客户维护 费	4,316.37	8,924.12
应支付基金管理人的净管理费	73,807.51	87,730.27

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,530.95	24,163.65

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金	-	327.14	327.14
中国工商银行	-	134.65	134.65
合计	-	461.79	461.79
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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金	-	453.34	453.34
中国工商银行	-	153.26	153.26
合计	-	606.60	606.60

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
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	56.78%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
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	50.87%	-

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。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,440,584.44	5,408.21	2,163,721.04	4,557.65

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。

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（2024 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公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,440,584.44	-	-	-	2,440,584.44
结算备付金	170,135.62	-	-	-	170,135.62
存出保证金	2,736.95	-	-	-	2,736.95
交易性金融资产	-	-	-	21,970,885.80	21,970,885.80
应收申购款	-	-	-	1,215.60	1,215.60
其他资产	-	-	-	65.00	65.00
资产总计	2,613,457.01	-	-	21,972,166.40	24,585,623.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,156.57	1,156.57
应付管理人报酬	-	-	-	12,387.28	12,387.28
应付托管费	-	-	-	3,096.83	3,096.83
应付销售服务费	-	-	-	378.19	378.19
其他负债	-	-	-	41,471.06	41,471.06
负债总计	-	-	-	58,489.93	58,489.93
利率敏感度缺口	2,613,457.01	-	-	21,913,676.47	24,527,133.48
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，并按照合同约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

注：基金本期末（上期末）持有的资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

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 2024年6月30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	21,970,885.80	89.58	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	21,970,885.80	89.58	24,015,734.32	64.58

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,397,644.99	1,975,870.92
	业绩比较基准下降 5%	-2,397,644.99	-1,975,870.92

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	21,970,885.80	23,993,686.32
第二层次	-	22,048.00
第三层次	-	-
合计	21,970,885.80	24,015,734.32

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券，若不存在活跃市场未经调整的报价（包括重大事项、新发未上市等原因所致），本基金不会于此期间将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,970,885.80	89.36
	其中：股票	21,970,885.80	89.36
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	2,610,720.06	10.62
8	其他各项资产	4,017.55	0.02
9	合计	24,585,623.41	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	229,889.00	0.94
B	采矿业	1,525,670.84	6.22
C	制造业	14,504,876.08	59.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	872,298.00	3.56
E	建筑业	350,929.01	1.43
F	批发和零售业	401,523.72	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	594,152.68	2.42
H	住宿和餐饮业	4,768.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,737,695.97	7.08
J	金融业	634,703.70	2.59
K	房地产业	130,936.00	0.53
L	租赁和商务服务业	196,628.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	117,948.81	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	220,568.99	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	98,026.00	0.40
Q	卫生和社会工作	23,082.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	317,333.00	1.29
S	综合	9,856.00	0.04
	合计	21,970,885.80	89.58

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	600519	贵州茅台	200	293,478.00	1.20
2	002475	立讯精密	6,578	258,581.18	1.05
3	002422	科伦药业	6,700	203,211.00	0.83
4	002384	东山精密	9,082	187,997.40	0.77
5	600489	中金黄金	12,400	183,520.00	0.75
6	600028	中国石化	27,100	171,272.00	0.70
7	601717	郑煤机	10,671	157,930.80	0.64
8	688111	金山办公	693	157,657.50	0.64
9	601728	中国电信	25,600	157,440.00	0.64
10	300679	电连技术	3,800	152,874.00	0.62
11	600161	天坛生物	6,240	152,256.00	0.62
12	300394	天孚通信	1,720	152,082.40	0.62
13	000975	山金国际	9,100	148,239.00	0.60
14	600690	海尔智家	5,222	148,200.36	0.60
15	600642	申能股份	16,700	147,461.00	0.60
16	002273	水晶光电	8,500	144,330.00	0.59
17	300750	宁德时代	800	144,024.00	0.59
18	603605	珀莱雅	1,266	140,513.34	0.57
19	601808	中海油服	7,800	134,160.00	0.55
20	002558	巨人网络	14,100	133,104.00	0.54
21	601600	中国铝业	17,300	131,999.00	0.54
22	603181	皇马科技	14,600	131,254.00	0.54
23	600795	国电电力	21,600	129,384.00	0.53
24	000883	湖北能源	21,500	129,215.00	0.53
25	300498	温氏股份	6,500	128,830.00	0.53
26	000725	京东方 A	31,200	127,608.00	0.52
27	002180	纳思达	4,800	126,816.00	0.52
28	002128	电投能源	6,000	126,600.00	0.52
29	600547	山东黄金	4,600	125,948.00	0.51
30	688328	深科达	8,771	124,811.33	0.51
31	002532	天山铝业	15,100	122,461.00	0.50
32	601919	中远海控	7,900	122,371.00	0.50
33	600426	华鲁恒升	4,500	119,880.00	0.49
34	300633	开立医疗	3,000	118,740.00	0.48
35	600066	宇通客车	4,600	118,680.00	0.48
36	688772	珠海冠宇	7,921	118,022.90	0.48
37	002179	中航光电	3,100	117,955.00	0.48
38	603589	口子窖	3,000	117,570.00	0.48
39	300408	三环集团	4,000	116,760.00	0.48
40	300308	中际旭创	841	115,957.08	0.47
41	600406	国电南瑞	4,600	114,816.00	0.47
42	601328	交通银行	14,800	110,556.00	0.45

43	000408	藏格矿业	4,500	108,315.00	0.44
44	688475	萤石网络	3,170	108,128.70	0.44
45	600060	海信视像	4,314	106,728.36	0.44
46	688099	晶晨股份	1,795	106,479.40	0.43
47	600845	宝信软件	3,240	103,453.20	0.42
48	603997	继峰股份	10,100	103,323.00	0.42
49	601668	中国建筑	19,431	103,178.61	0.42
50	002517	恺英网络	10,300	98,365.00	0.40
51	605098	行动教育	2,300	98,026.00	0.40
52	688311	盟升电子	4,775	97,839.75	0.40
53	600875	东方电气	5,300	97,785.00	0.40
54	688010	福光股份	6,156	95,848.92	0.39
55	002938	鹏鼎控股	2,400	95,424.00	0.39
56	688178	万德斯	9,252	95,388.12	0.39
57	688496	清越科技	10,114	93,453.36	0.38
58	603279	景津装备	4,300	93,267.00	0.38
59	603728	鸣志电器	2,300	92,529.00	0.38
60	688355	明志科技	6,840	91,792.80	0.37
61	300146	汤臣倍健	6,600	89,430.00	0.36
62	300795	米奥会展	5,100	89,403.00	0.36
63	301015	百洋医药	3,700	87,061.00	0.35
64	000858	五粮液	661	84,634.44	0.35
65	603606	东方电缆	1,700	82,977.00	0.34
66	300433	蓝思科技	4,500	82,125.00	0.33
67	688136	科兴制药	4,870	81,621.20	0.33
68	601989	中国重工	16,300	80,359.00	0.33
69	300181	佐力药业	5,200	78,624.00	0.32
70	600887	伊利股份	3,000	77,520.00	0.32
71	002884	凌霄泵业	4,000	76,800.00	0.31
72	600900	长江电力	2,600	75,192.00	0.31
73	000338	潍柴动力	4,600	74,704.00	0.30
74	000738	航发控制	3,700	74,259.00	0.30
75	300340	科恒股份	10,700	73,830.00	0.30
76	600760	中航沈飞	1,800	72,180.00	0.29
77	605500	森林包装	11,600	71,340.00	0.29
78	301055	张小泉	6,000	71,160.00	0.29
79	000651	格力电器	1,800	70,596.00	0.29
80	601000	唐山港	15,000	70,500.00	0.29
81	601991	大唐发电	23,100	69,531.00	0.28
82	002121	科陆电子	18,300	69,357.00	0.28
83	000698	沈阳化工	22,800	69,312.00	0.28
84	002123	梦网科技	9,800	68,894.00	0.28
85	000400	许继电气	2,000	68,820.00	0.28

86	600970	中材国际	5,700	68,742.00	0.28
87	301195	北路智控	2,300	68,402.00	0.28
88	601633	长城汽车	2,700	68,310.00	0.28
89	301062	上海艾录	6,600	67,386.00	0.27
90	300132	青松股份	19,300	67,164.00	0.27
91	300168	万达信息	14,100	66,975.00	0.27
92	300661	圣邦股份	800	66,224.00	0.27
93	002463	沪电股份	1,800	65,700.00	0.27
94	688466	金科环境	5,479	65,309.68	0.27
95	002818	富森美	5,300	64,978.00	0.26
96	000933	神火股份	3,200	64,736.00	0.26
97	601366	利群股份	14,200	63,900.00	0.26
98	688208	道通科技	2,629	63,464.06	0.26
99	601921	浙版传媒	8,300	63,412.00	0.26
100	002353	杰瑞股份	1,800	63,144.00	0.26
101	600039	四川路桥	7,900	62,331.00	0.25
102	601899	紫金矿业	3,500	61,495.00	0.25
103	600707	彩虹股份	9,000	61,290.00	0.25
104	600295	鄂尔多斯	6,100	60,512.00	0.25
105	600967	内蒙一机	8,375	60,300.00	0.25
106	002465	海格通信	5,700	59,052.00	0.24
107	601857	中国石油	5,700	58,824.00	0.24
108	600893	航发动力	1,600	58,480.00	0.24
109	601865	福莱特	2,900	58,290.00	0.24
110	600233	圆通速递	3,700	57,905.00	0.24
111	301051	信濠光电	2,200	57,706.00	0.24
112	300207	欣旺达	3,800	57,646.00	0.24
113	000039	中集集团	6,200	57,412.00	0.23
114	688217	睿昂基因	2,899	57,226.26	0.23
115	301155	海力风电	1,400	56,322.00	0.23
116	601636	旗滨集团	8,500	54,825.00	0.22
117	600348	华阳股份	5,500	54,780.00	0.22
118	002252	上海莱士	7,000	54,740.00	0.22
119	688375	国博电子	767	54,180.88	0.22
120	601225	陕西煤业	2,100	54,117.00	0.22
121	002028	思源电气	800	53,520.00	0.22
122	603883	老百姓	2,860	52,509.60	0.21
123	601985	中国核电	4,900	52,234.00	0.21
124	000333	美的集团	800	51,600.00	0.21
125	300858	科拓生物	3,500	51,520.00	0.21
126	688598	金博股份	1,793	50,741.90	0.21
127	600566	济川药业	1,600	50,736.00	0.21
128	600989	宝丰能源	2,900	50,257.00	0.20

129	002594	比亚迪	200	50,050.00	0.20
130	002840	华统股份	3,000	49,770.00	0.20
131	002068	黑猫股份	7,000	49,700.00	0.20
132	601898	中煤能源	3,800	47,424.00	0.19
133	600398	海澜之家	5,100	47,124.00	0.19
134	603993	洛阳钼业	5,500	46,750.00	0.19
135	002415	海康威视	1,500	46,365.00	0.19
136	688383	新益昌	873	45,492.03	0.19
137	000830	鲁西化工	3,900	45,201.00	0.18
138	002372	伟星新材	2,900	44,718.00	0.18
139	603587	地素时尚	3,600	44,208.00	0.18
140	600115	中国东航	11,000	44,110.00	0.18
141	002185	华天科技	5,400	44,010.00	0.18
142	603730	岱美股份	4,400	43,736.00	0.18
143	601628	中国人寿	1,400	43,470.00	0.18
144	600761	安徽合力	2,000	43,280.00	0.18
145	002635	安洁科技	2,800	43,232.00	0.18
146	000568	泸州老窖	301	43,190.49	0.18
147	002928	华夏航空	6,800	43,112.00	0.18
148	300395	菲利华	1,400	43,050.00	0.18
149	688110	东芯股份	2,257	43,040.99	0.18
150	688008	澜起科技	752	42,984.32	0.18
151	688281	华秦科技	511	42,576.52	0.17
152	603599	广信股份	3,500	42,455.00	0.17
153	000728	国元证券	7,000	42,420.00	0.17
154	603297	永新光学	700	42,343.00	0.17
155	002916	深南电路	400	42,308.00	0.17
156	002299	圣农发展	3,100	42,284.00	0.17
157	000596	古井贡酒	200	42,214.00	0.17
158	600256	广汇能源	6,300	42,210.00	0.17
159	600048	保利发展	4,800	42,048.00	0.17
160	002595	豪迈科技	1,100	41,987.00	0.17
161	300144	宋城演艺	5,200	41,756.00	0.17
162	000951	中国重汽	2,901	41,542.32	0.17
163	002444	巨星科技	1,670	41,249.00	0.17
164	002608	江苏国信	5,300	41,075.00	0.17
165	300124	汇川技术	800	41,040.00	0.17
166	300182	捷成股份	11,000	40,810.00	0.17
167	300628	亿联网络	1,100	40,447.00	0.16
168	002139	拓邦股份	3,800	40,356.00	0.16
169	300049	福瑞股份	800	40,272.00	0.16
170	002567	唐人神	7,500	40,200.00	0.16
171	002387	维信诺	6,600	40,128.00	0.16

172	603855	华荣股份	1,800	39,798.00	0.16
173	000703	恒逸石化	5,600	39,704.00	0.16
174	688009	中国通号	6,540	39,240.00	0.16
175	601298	青岛港	4,100	39,196.00	0.16
176	300580	贝斯特	2,646	38,896.20	0.16
177	300627	华测导航	1,300	38,805.00	0.16
178	002020	京新药业	3,700	38,739.00	0.16
179	600285	羚锐制药	1,600	38,736.00	0.16
180	600660	福耀玻璃	800	38,320.00	0.16
181	603228	景旺电子	1,200	38,160.00	0.16
182	688389	普门科技	2,340	38,048.40	0.16
183	688088	虹软科技	1,314	37,922.04	0.15
184	002311	海大集团	800	37,640.00	0.15
185	002223	鱼跃医疗	1,000	37,600.00	0.15
186	603556	海兴电力	800	37,464.00	0.15
187	688579	山大地纬	4,741	37,216.85	0.15
188	000513	丽珠集团	1,000	37,210.00	0.15
189	002930	宏川智慧	3,000	37,200.00	0.15
190	601965	中国汽研	2,200	37,158.00	0.15
191	603345	安井食品	500	37,155.00	0.15
192	002019	亿帆医药	3,000	37,080.00	0.15
193	688575	亚辉龙	1,589	37,055.48	0.15
194	300251	光线传媒	4,400	37,004.00	0.15
195	603369	今世缘	800	36,960.00	0.15
196	600511	国药股份	1,200	36,948.00	0.15
197	688153	唯捷创芯	994	36,778.00	0.15
198	600223	福瑞达	5,200	36,764.00	0.15
199	605166	聚合顺	3,500	36,715.00	0.15
200	688685	迈信林	1,498	36,626.10	0.15
201	002001	新和成	1,900	36,480.00	0.15
202	000807	云铝股份	2,700	36,477.00	0.15
203	002837	英维克	1,700	36,363.00	0.15
204	000937	冀中能源	5,400	36,180.00	0.15
205	001979	招商蛇口	4,100	36,039.00	0.15
206	600114	东睦股份	2,500	35,975.00	0.15
207	605060	联德股份	2,500	35,925.00	0.15
208	603565	中谷物流	4,100	35,834.00	0.15
209	688377	迪威尔	2,722	35,658.20	0.15
210	688260	昀冢科技	2,397	35,643.39	0.15
211	002955	鸿合科技	1,500	35,070.00	0.14
212	002250	联化科技	7,300	35,040.00	0.14
213	603806	福斯特	2,380	34,986.00	0.14
214	000521	长虹美菱	4,600	34,868.00	0.14

215	000157	中联重科	4,500	34,560.00	0.14
216	688253	英诺特	905	34,489.55	0.14
217	000156	华数传媒	5,400	33,912.00	0.14
218	002597	金禾实业	1,700	33,813.00	0.14
219	600346	恒力石化	2,400	33,480.00	0.14
220	300770	新媒股份	1,000	33,380.00	0.14
221	603998	方盛制药	3,200	32,864.00	0.13
222	002100	天康生物	4,700	32,571.00	0.13
223	000932	华菱钢铁	7,300	32,339.00	0.13
224	600941	中国移动	300	32,250.00	0.13
225	688201	信安世纪	2,702	31,910.62	0.13
226	688372	伟测科技	809	31,817.97	0.13
227	300502	新易盛	300	31,665.00	0.13
228	688236	春立医疗	2,208	31,309.44	0.13
229	600803	新奥股份	1,500	31,200.00	0.13
230	688590	新致软件	2,416	31,166.40	0.13
231	002149	西部材料	2,200	30,712.00	0.13
232	600820	隧道股份	4,700	30,691.00	0.13
233	688041	海光信息	434	30,518.88	0.12
234	601231	环旭电子	1,865	29,933.25	0.12
235	600183	生益科技	1,400	29,484.00	0.12
236	002571	德力股份	6,000	29,220.00	0.12
237	688059	华锐精密	642	29,133.96	0.12
238	300760	迈瑞医疗	100	29,091.00	0.12
239	000983	山西焦煤	2,800	28,868.00	0.12
240	600497	驰宏锌锗	5,300	28,302.00	0.12
241	600901	江苏金租	5,600	28,280.00	0.12
242	000729	燕京啤酒	3,200	28,256.00	0.12
243	688468	科美诊断	4,457	28,212.81	0.12
244	001328	登康口腔	1,100	27,830.00	0.11
245	603915	国茂股份	2,700	27,783.00	0.11
246	000999	华润三九	650	27,677.00	0.11
247	002948	青岛银行	8,200	27,634.00	0.11
248	002003	伟星股份	2,200	27,610.00	0.11
249	688435	英方软件	1,106	27,605.76	0.11
250	600886	国投电力	1,500	27,360.00	0.11
251	601319	中国人保	5,300	27,295.00	0.11
252	002152	广电运通	2,600	27,196.00	0.11
253	600879	航天电子	3,500	27,195.00	0.11
254	000690	宝新能源	5,300	27,030.00	0.11
255	688625	呈和科技	741	26,942.76	0.11
256	688252	天德钰	1,848	26,851.44	0.11
257	688118	普元信息	1,854	26,753.22	0.11

258	600422	昆药集团	1,500	26,745.00	0.11
259	600373	中文传媒	1,800	26,712.00	0.11
260	300253	卫宁健康	4,500	26,550.00	0.11
261	000778	新兴铸管	7,600	26,448.00	0.11
262	000768	中航西飞	1,100	26,433.00	0.11
263	603507	振江股份	800	26,256.00	0.11
264	600582	天地科技	3,800	26,182.00	0.11
265	688373	盟科药业	6,001	26,104.35	0.11
266	002755	奥赛康	2,700	26,055.00	0.11
267	600329	达仁堂	800	25,912.00	0.11
268	002989	中天精装	1,700	25,857.00	0.11
269	000708	中信特钢	1,901	25,796.57	0.11
270	688173	希荻微	2,318	25,567.54	0.10
271	601702	华峰铝业	1,400	25,564.00	0.10
272	002697	红旗连锁	5,500	25,465.00	0.10
273	600458	时代新材	2,500	25,250.00	0.10
274	002332	仙琚制药	2,200	25,102.00	0.10
275	600688	上海石化	9,600	25,056.00	0.10
276	688139	海尔生物	671	24,961.20	0.10
277	600885	宏发股份	900	24,912.00	0.10
278	601139	深圳燃气	3,700	24,716.00	0.10
279	688317	之江生物	1,714	24,698.74	0.10
280	688319	欧林生物	2,752	24,630.40	0.10
281	300886	华业香料	1,500	24,630.00	0.10
282	601577	长沙银行	3,000	24,540.00	0.10
283	002807	江阴银行	6,500	24,505.00	0.10
284	600861	北京人力	1,500	24,480.00	0.10
285	600908	无锡银行	4,600	24,472.00	0.10
286	688150	莱特光电	1,261	24,463.40	0.10
287	688036	传音控股	319	24,416.26	0.10
288	002544	普天科技	1,300	24,297.00	0.10
289	601825	沪农商行	3,600	24,192.00	0.10
290	300218	安利股份	1,600	24,128.00	0.10
291	002839	张家港行	6,000	24,120.00	0.10
292	600395	盘江股份	4,000	24,040.00	0.10
293	601187	厦门银行	4,500	23,985.00	0.10
294	688176	亚虹医药	4,683	23,930.13	0.10
295	002858	力盛体育	2,300	23,920.00	0.10
296	300871	回盛生物	2,500	23,850.00	0.10
297	688586	江航装备	2,564	23,845.20	0.10
298	002380	科远智慧	1,300	23,790.00	0.10
299	688678	福立旺	2,191	23,728.53	0.10
300	605068	明新旭腾	1,800	23,724.00	0.10

301	000825	太钢不锈	7,000	23,660.00	0.10
302	001206	依依股份	1,800	23,436.00	0.10
302	300371	汇中股份	2,800	23,436.00	0.10
303	002737	葵花药业	1,000	23,380.00	0.10
304	300883	龙利得	5,500	23,265.00	0.09
305	688365	光云科技	3,862	23,249.24	0.09
306	600782	新钢股份	7,000	23,240.00	0.09
307	688096	京源环保	4,590	23,179.50	0.09
308	300702	天宇股份	1,300	23,179.00	0.09
309	603630	拉芳家化	2,200	23,122.00	0.09
310	603385	惠达卫浴	4,200	23,058.00	0.09
311	601990	南京证券	3,000	23,040.00	0.09
312	002416	爱施德	2,600	23,010.00	0.09
313	300573	兴齐眼药	140	22,960.00	0.09
314	603917	合力科技	2,100	22,722.00	0.09
315	300765	新诺威	900	22,707.00	0.09
316	300385	雪浪环境	6,700	22,579.00	0.09
317	603359	东珠生态	6,200	22,506.00	0.09
318	002798	帝欧家居	6,900	22,494.00	0.09
319	600598	北大荒	1,800	22,482.00	0.09
320	601108	财通证券	3,400	22,474.00	0.09
321	688550	瑞联新材	967	22,424.73	0.09
322	002281	光迅科技	600	22,422.00	0.09
323	600377	宁沪高速	1,774	22,352.40	0.09
324	301296	新巨丰	3,100	22,351.00	0.09
325	688248	南网科技	753	22,311.39	0.09
326	600158	中体产业	2,900	22,301.00	0.09
327	600219	南山铝业	5,800	22,098.00	0.09
328	002919	名臣健康	1,900	22,059.00	0.09
329	688108	赛诺医疗	2,450	21,903.00	0.09
330	600600	青岛啤酒	300	21,831.00	0.09
331	600755	厦门国贸	3,000	21,510.00	0.09
332	300866	安克创新	300	21,363.00	0.09
333	688610	埃科光电	635	21,355.05	0.09
334	600663	陆家嘴	2,400	21,168.00	0.09
335	300383	光环新网	2,500	21,125.00	0.09
336	600809	山西汾酒	100	21,088.00	0.09
337	603878	武进不锈	3,200	20,928.00	0.09
338	601928	凤凰传媒	1,900	20,824.00	0.08
339	001201	东瑞股份	1,100	20,394.00	0.08
340	000100	TCL 科技	4,700	20,304.00	0.08
341	002032	苏泊尔	400	20,040.00	0.08
342	002472	双环传动	900	19,818.00	0.08

343	000887	中鼎股份	1,600	19,584.00	0.08
344	603529	爱玛科技	700	19,131.00	0.08
345	688778	厦钨新能	610	19,056.40	0.08
346	603707	健友股份	1,600	19,008.00	0.08
347	600549	厦门钨业	1,100	18,975.00	0.08
348	603225	新凤鸣	1,200	18,708.00	0.08
349	000683	远兴能源	2,700	18,657.00	0.08
350	601006	大秦铁路	2,600	18,616.00	0.08
351	601975	招商南油	5,100	18,309.00	0.07
352	002487	大金重工	800	18,304.00	0.07
353	002831	裕同科技	684	17,503.56	0.07
354	600282	南钢股份	3,500	17,430.00	0.07
355	601098	中南传媒	1,400	17,388.00	0.07
356	002230	科大讯飞	400	17,180.00	0.07
357	600710	苏美达	2,100	17,115.00	0.07
358	688229	博睿数据	662	17,026.64	0.07
359	601618	中国中冶	5,400	16,740.00	0.07
360	000930	中粮科技	3,300	16,599.00	0.07
361	601918	新集能源	1,700	16,575.00	0.07
362	000650	仁和药业	2,800	16,520.00	0.07
363	002456	欧菲光	2,100	16,401.00	0.07
364	002600	领益智造	2,300	16,376.00	0.07
365	300529	健帆生物	600	16,326.00	0.07
366	002887	绿茵生态	2,500	16,275.00	0.07
367	002408	齐翔腾达	2,900	16,240.00	0.07
368	002683	广东宏大	800	16,104.00	0.07
369	002531	天顺风能	1,800	16,092.00	0.07
370	600050	中国联通	3,400	15,980.00	0.07
371	300319	麦捷科技	1,700	15,861.00	0.06
372	000598	兴蓉环境	2,100	15,792.00	0.06
373	601658	邮储银行	3,100	15,717.00	0.06
374	601288	农业银行	3,600	15,696.00	0.06
375	002563	森马服饰	2,700	15,687.00	0.06
376	688596	正帆科技	475	15,675.00	0.06
377	600276	恒瑞医药	400	15,384.00	0.06
378	002653	海思科	500	15,350.00	0.06
379	600521	华海药业	900	15,345.00	0.06
380	600141	兴发集团	800	15,264.00	0.06
381	002497	雅化集团	1,700	15,164.00	0.06
382	688107	安路科技	595	15,124.90	0.06
383	688520	神州细胞	383	15,071.05	0.06
384	002064	华峰化学	2,100	15,057.00	0.06
385	600177	雅戈尔	2,100	14,952.00	0.06

386	603317	天味食品	1,300	14,833.00	0.06
387	600332	白云山	500	14,665.00	0.06
388	000547	航天发展	2,500	14,650.00	0.06
389	600399	抚顺特钢	2,600	14,638.00	0.06
390	600011	华能国际	1,500	14,430.00	0.06
391	002063	远光软件	2,740	14,357.60	0.06
392	300456	赛微电子	900	14,283.00	0.06
393	000001	平安银行	1,400	14,210.00	0.06
394	605358	立昂微	600	13,884.00	0.06
395	002153	石基信息	2,420	13,866.60	0.06
396	600535	天士力	1,100	13,838.00	0.06
397	688425	铁建重工	3,756	13,822.08	0.06
398	600352	浙江龙盛	1,600	13,744.00	0.06
399	002138	顺络电子	500	13,730.00	0.06
400	002056	横店东磁	1,100	13,717.00	0.06
401	600096	云天化	700	13,594.00	0.06
402	002446	盛路通信	2,400	13,560.00	0.06
403	300296	利亚德	3,000	13,500.00	0.06
404	002044	美年健康	3,500	13,230.00	0.05
405	000967	盈峰环境	3,100	13,113.00	0.05
406	688212	澳华内镜	324	12,963.24	0.05
407	600008	首创环保	4,800	12,864.00	0.05
408	601016	节能风电	4,300	12,857.00	0.05
409	603786	科博达	200	12,830.00	0.05
410	600339	中油工程	4,000	12,480.00	0.05
411	300699	光威复材	500	12,415.00	0.05
412	688029	南微医学	200	12,312.00	0.05
413	603060	国检集团	2,100	12,264.00	0.05
414	002065	东华软件	2,700	12,204.00	0.05
415	600391	航发科技	800	12,200.00	0.05
416	603826	坤彩科技	420	12,167.40	0.05
417	300390	天华新能	700	12,026.00	0.05
418	003006	百亚股份	500	11,850.00	0.05
419	600848	上海临港	1,300	11,843.00	0.05
420	601801	皖新传媒	1,700	11,781.00	0.05
421	600641	万业企业	1,000	11,750.00	0.05
422	600062	华润双鹤	600	11,748.00	0.05
423	603379	三美股份	300	11,742.00	0.05
424	000811	冰轮环境	1,200	11,580.00	0.05
425	001872	招商港口	600	11,550.00	0.05
426	300316	晶盛机电	400	11,492.00	0.05
427	300567	精测电子	200	11,302.00	0.05
428	603939	益丰药房	460	11,293.00	0.05

429	002557	洽洽食品	400	11,276.00	0.05
430	601666	平煤股份	1,000	11,200.00	0.05
431	002978	安宁股份	400	11,144.00	0.05
432	300451	创业慧康	3,200	11,072.00	0.05
433	002507	涪陵榨菜	900	11,025.00	0.04
434	603712	七一二	600	10,914.00	0.04
435	600704	物产中大	2,500	10,850.00	0.04
436	601058	赛轮轮胎	774	10,836.00	0.04
437	600350	山东高速	1,200	10,620.00	0.04
438	601611	中国核建	1,300	10,517.00	0.04
439	000636	风华高科	800	10,448.00	0.04
440	600027	华电国际	1,500	10,410.00	0.04
441	002439	启明星辰	600	10,356.00	0.04
442	601198	东兴证券	1,300	10,348.00	0.04
443	600985	淮北矿业	616	10,311.84	0.04
444	300638	广和通	600	10,260.00	0.04
445	603185	弘元绿能	600	10,254.00	0.04
446	600909	华安证券	2,400	10,104.00	0.04
447	002468	申通快递	1,200	10,080.00	0.04
448	600938	中国海油	300	9,900.00	0.04
449	002291	遥望科技	2,300	9,890.00	0.04
450	600673	东阳光	1,400	9,856.00	0.04
451	600988	赤峰黄金	600	9,804.00	0.04
452	000630	铜陵有色	2,700	9,747.00	0.04
453	000543	皖能电力	1,100	9,735.00	0.04
454	603816	顾家家居	300	9,687.00	0.04
455	600827	百联股份	1,300	9,594.00	0.04
456	601598	中国外运	1,700	9,571.00	0.04
457	600498	烽火通信	600	9,540.00	0.04
458	688122	西部超导	248	9,503.36	0.04
459	600862	中航高科	500	9,390.00	0.04
460	000623	吉林敖东	700	9,380.00	0.04
461	601568	北元集团	2,500	9,275.00	0.04
462	600143	金发科技	1,400	9,254.00	0.04
463	603658	安图生物	200	9,214.00	0.04
464	300114	中航电测	200	9,050.00	0.04
465	688819	天能股份	379	9,042.94	0.04
466	600873	梅花生物	900	9,018.00	0.04
467	600416	湘电股份	900	8,946.00	0.04
468	300003	乐普医疗	600	8,904.00	0.04
469	002430	杭氧股份	400	8,900.00	0.04
470	600699	均胜电子	600	8,892.00	0.04
471	300284	苏交科	1,100	8,888.00	0.04

472	601088	中国神华	200	8,874.00	0.04
473	002925	盈趣科技	700	8,869.00	0.04
474	002518	科士达	500	8,850.00	0.04
475	601311	骆驼股份	1,100	8,822.00	0.04
476	301263	泰恩康	700	8,771.00	0.04
477	688158	优刻得	856	8,756.88	0.04
478	002714	牧原股份	200	8,720.00	0.04
479	300274	阳光电源	140	8,684.20	0.04
480	600968	海油发展	2,100	8,652.00	0.04
481	001203	大中矿业	900	8,649.00	0.04
482	600737	中粮糖业	900	8,631.00	0.04
483	000155	川能动力	800	8,616.00	0.04
484	688567	孚能科技	893	8,572.80	0.03
485	300037	新宙邦	300	8,568.00	0.03
486	600063	皖维高新	2,400	8,448.00	0.03
487	688728	格科微	692	8,380.12	0.03
488	002008	大族激光	400	8,320.00	0.03
489	002340	格林美	1,300	8,281.00	0.03
490	600801	华新水泥	600	8,250.00	0.03
491	002373	千方科技	900	8,163.00	0.03
492	601222	林洋能源	1,300	8,151.00	0.03
493	605589	圣泉集团	400	8,116.00	0.03
494	688518	联赢激光	480	8,016.00	0.03
495	002945	华林证券	800	7,984.00	0.03
496	300373	扬杰科技	200	7,780.00	0.03
497	000166	申万宏源	1,800	7,758.00	0.03
498	002850	科达利	100	7,638.00	0.03
499	002390	信邦制药	2,300	7,613.00	0.03
500	600025	华能水电	700	7,546.00	0.03
501	002266	浙富控股	2,700	7,533.00	0.03
502	300088	长信科技	1,600	7,520.00	0.03
503	002402	和而泰	700	7,497.00	0.03
504	300986	志特新材	1,100	7,447.00	0.03
505	600496	精工钢构	2,900	7,424.00	0.03
506	600528	中铁工业	1,000	7,320.00	0.03
507	601696	中银证券	800	7,264.00	0.03
508	600201	生物股份	1,000	7,210.00	0.03
509	002203	海亮股份	900	7,182.00	0.03
510	002649	博彦科技	900	7,164.00	0.03
511	603233	大参林	500	7,150.00	0.03
512	600315	上海家化	400	7,112.00	0.03
513	300382	斯莱克	1,200	7,092.00	0.03
514	688126	沪硅产业	510	7,043.10	0.03

515	301236	软通动力	200	7,042.00	0.03
516	002120	韵达股份	900	6,966.00	0.03
517	600999	招商证券	500	6,955.00	0.03
518	600750	江中药业	300	6,933.00	0.03
519	688349	三一重能	279	6,930.36	0.03
520	603927	中科软	380	6,874.20	0.03
521	300587	天铁股份	1,700	6,868.00	0.03
522	600299	安迪苏	700	6,790.00	0.03
523	600195	中牧股份	900	6,741.00	0.03
524	600415	小商品城	900	6,678.00	0.03
525	601939	建设银行	900	6,660.00	0.03
526	688270	臻镭科技	254	6,629.40	0.03
527	002690	美亚光电	400	6,600.00	0.03
528	603056	德邦股份	500	6,550.00	0.03
529	000581	威孚高科	400	6,512.00	0.03
530	600583	海油工程	1,100	6,501.00	0.03
531	600029	南方航空	1,100	6,479.00	0.03
532	003031	中瓷电子	140	6,473.60	0.03
533	600516	方大炭素	1,500	6,465.00	0.03
534	000921	海信家电	200	6,448.00	0.03
535	002958	青农商行	2,400	6,432.00	0.03
536	300856	科思股份	200	6,402.00	0.03
537	603156	养元饮品	300	6,381.00	0.03
538	002434	万里扬	1,300	6,370.00	0.03
539	002409	雅克科技	100	6,291.00	0.03
540	000423	东阿阿胶	100	6,260.00	0.03
541	601958	金铂股份	600	6,246.00	0.03
542	601933	永辉超市	2,500	6,200.00	0.03
543	002249	大洋电机	1,300	6,149.00	0.03
544	300113	顺网科技	600	6,144.00	0.03
545	600587	新华医疗	390	6,138.60	0.03
546	000066	中国长城	700	6,125.00	0.02
547	300388	节能国祯	1,100	6,094.00	0.02
548	603866	桃李面包	1,200	6,084.00	0.02
549	002739	万达电影	500	6,045.00	0.02
550	603338	浙江鼎力	100	6,042.00	0.02
551	300232	洲明科技	1,135	5,924.70	0.02
552	603893	瑞芯微	100	5,917.00	0.02
553	600482	中国动力	300	5,844.00	0.02
554	601997	贵阳银行	1,100	5,797.00	0.02
555	600995	南网储能	600	5,796.00	0.02
556	601228	广州港	1,900	5,795.00	0.02
557	600378	昊华科技	200	5,780.00	0.02

558	601117	中国化学	700	5,768.00	0.02
559	600015	华夏银行	900	5,760.00	0.02
560	600390	五矿资本	1,400	5,670.00	0.02
561	600486	扬农化工	100	5,645.00	0.02
562	000090	天健集团	1,400	5,628.00	0.02
562	002705	新宝股份	400	5,628.00	0.02
562	002815	崇达技术	600	5,628.00	0.02
563	600500	中化国际	1,600	5,584.00	0.02
564	002078	太阳纸业	400	5,580.00	0.02
565	601966	玲珑轮胎	300	5,511.00	0.02
566	601138	工业富联	200	5,480.00	0.02
567	600562	国睿科技	400	5,464.00	0.02
568	002155	湖南黄金	300	5,430.00	0.02
569	000739	普洛药业	400	5,428.00	0.02
570	600839	四川长虹	1,200	5,388.00	0.02
571	601168	西部矿业	300	5,385.00	0.02
572	600977	中国电影	500	5,380.00	0.02
573	601128	常熟银行	710	5,374.70	0.02
574	300677	英科医疗	200	5,362.00	0.02
575	002294	信立泰	200	5,326.00	0.02
576	688330	宏力达	257	5,240.23	0.02
577	002215	诺普信	700	5,215.00	0.02
578	600271	航天信息	700	5,152.00	0.02
579	300416	苏试试验	400	5,144.00	0.02
580	603218	日月股份	500	5,135.00	0.02
581	002244	滨江集团	700	5,082.00	0.02
582	002158	汉钟精机	300	5,016.00	0.02
583	600588	用友网络	500	5,000.00	0.02
584	000553	安道麦 A	1,100	4,994.00	0.02
585	000998	隆平高科	500	4,915.00	0.02
586	003012	东鹏控股	800	4,888.00	0.02
587	600037	歌华有线	800	4,784.00	0.02
588	002414	高德红外	800	4,712.00	0.02
589	601916	浙商银行	1,700	4,692.00	0.02
590	601169	北京银行	800	4,672.00	0.02
591	600863	内蒙华电	1,000	4,640.00	0.02
592	300776	帝尔激光	100	4,596.00	0.02
593	605077	华康股份	300	4,575.00	0.02
594	600109	国金证券	600	4,530.00	0.02
595	600126	杭钢股份	1,100	4,521.00	0.02
596	300850	新强联	300	4,506.00	0.02
597	600742	一汽富维	600	4,470.00	0.02
598	688331	荣昌生物	103	4,449.60	0.02

599	000810	创维数字	500	4,290.00	0.02
600	600637	东方明珠	700	4,256.00	0.02
601	000591	太阳能	900	4,239.00	0.02
602	600499	科达制造	500	4,215.00	0.02
603	601318	中国平安	100	4,136.00	0.02
604	603456	九洲药业	300	4,116.00	0.02
604	603568	伟明环保	200	4,116.00	0.02
605	003022	联泓新科	300	4,113.00	0.02
605	603239	浙江仙通	300	4,113.00	0.02
606	600821	金开新能	800	4,112.00	0.02
607	600038	中直股份	100	4,111.00	0.02
608	600320	振华重工	1,200	4,104.00	0.02
609	300568	星源材质	500	4,100.00	0.02
610	600150	中国船舶	100	4,071.00	0.02
611	600059	古越龙山	500	3,970.00	0.02
612	002326	永太科技	500	3,910.00	0.02
613	300861	美畅股份	200	3,870.00	0.02
614	603868	飞科电器	100	3,840.00	0.02
615	600166	福田汽车	1,700	3,825.00	0.02
615	601828	美凯龙	1,500	3,825.00	0.02
616	600998	九州通	774	3,777.12	0.02
617	000878	云南铜业	300	3,738.00	0.02
618	600428	中远海特	600	3,672.00	0.01
619	688006	杭可科技	210	3,664.50	0.01
620	688262	国芯科技	200	3,642.00	0.01
621	300803	指南针	100	3,641.00	0.01
622	600559	老白干酒	200	3,636.00	0.01
623	605305	中际联合	140	3,610.60	0.01
624	300244	迪安诊断	300	3,600.00	0.01
625	600125	铁龙物流	600	3,582.00	0.01
626	002756	永兴材料	100	3,578.00	0.01
627	600153	建发股份	400	3,572.00	0.01
628	301239	普瑞眼科	100	3,533.00	0.01
629	600859	王府井	300	3,522.00	0.01
630	688690	纳微科技	200	3,474.00	0.01
631	002010	传化智联	900	3,456.00	0.01
632	002212	天融信	700	3,409.00	0.01
633	688156	路德环境	253	3,347.19	0.01
634	300065	海兰信	500	3,305.00	0.01
635	300294	博雅生物	100	3,300.00	0.01
636	000959	首钢股份	1,200	3,264.00	0.01
637	300558	贝达药业	100	3,255.00	0.01
638	601333	广深铁路	1,000	3,240.00	0.01

639	688779	五矿新能	698	3,231.74	0.01
640	603305	旭升集团	300	3,168.00	0.01
641	600572	康恩贝	700	3,129.00	0.01
642	002245	蔚蓝锂芯	400	3,100.00	0.01
643	002060	广东建工	900	3,078.00	0.01
644	002081	金螳螂	1,000	3,030.00	0.01
645	000021	深科技	200	3,024.00	0.01
645	002267	陕天然气	400	3,024.00	0.01
646	001914	招商积余	300	3,006.00	0.01
647	002192	融捷股份	100	3,002.00	0.01
648	688033	天宜上佳	498	2,988.00	0.01
649	000786	北新建材	100	2,966.00	0.01
650	600129	太极集团	100	2,892.00	0.01
651	600018	上港集团	500	2,890.00	0.01
652	002276	万马股份	400	2,868.00	0.01
653	600888	新疆众和	400	2,828.00	0.01
654	000063	中兴通讯	100	2,797.00	0.01
655	600298	安琪酵母	100	2,793.00	0.01
656	601601	中国太保	100	2,786.00	0.01
657	600104	上汽集团	200	2,772.00	0.01
658	603882	金域医学	100	2,719.00	0.01
659	300604	长川科技	100	2,717.00	0.01
660	002385	大北农	700	2,695.00	0.01
661	601800	中国交建	300	2,682.00	0.01
662	002738	中矿资源	100	2,680.00	0.01
663	300673	佩蒂股份	200	2,624.00	0.01
664	002127	南极电商	1,000	2,600.00	0.01
665	000009	中国宝安	300	2,580.00	0.01
666	605007	五洲特纸	200	2,526.00	0.01
667	603871	嘉友国际	140	2,476.60	0.01
668	600258	首旅酒店	200	2,470.00	0.01
669	603737	三棵树	68	2,466.36	0.01
670	300379	东方通	300	2,424.00	0.01
671	600160	巨化股份	100	2,413.00	0.01
672	002876	三利谱	100	2,412.00	0.01
672	601179	中国西电	300	2,412.00	0.01
673	002984	森麒麟	100	2,409.00	0.01
674	601158	重庆水务	500	2,400.00	0.01
675	002318	久立特材	100	2,333.00	0.01
676	600754	锦江酒店	100	2,298.00	0.01
677	300761	立华股份	100	2,264.00	0.01
678	002511	中顺洁柔	300	2,076.00	0.01
679	600640	国脉文化	200	2,070.00	0.01

680	600765	中航重机	100	2,040.00	0.01
681	300396	迪瑞医疗	100	2,031.00	0.01
682	688718	唯赛勃	233	1,992.15	0.01
683	603558	健盛集团	200	1,990.00	0.01
684	600764	中国海防	100	1,963.00	0.01
685	300136	信维通信	100	1,958.00	0.01
686	603368	柳药集团	100	1,750.00	0.01
687	000898	鞍钢股份	800	1,696.00	0.01
688	605003	众望布艺	100	1,605.00	0.01
689	600418	江淮汽车	100	1,584.00	0.01
690	300595	欧普康视	100	1,568.00	0.01
691	000960	锡业股份	100	1,549.00	0.01
692	603517	绝味食品	100	1,540.00	0.01
693	002572	索菲亚	100	1,533.00	0.01
694	601665	齐鲁银行	300	1,473.00	0.01
695	000997	新大陆	100	1,391.00	0.01
696	600928	西安银行	400	1,308.00	0.01
697	002080	中材科技	100	1,290.00	0.01
698	002701	奥瑞金	300	1,248.00	0.01
699	002271	东方雨虹	100	1,234.00	0.01
700	600580	卧龙电驱	100	1,215.00	0.00
701	603885	吉祥航空	100	1,099.00	0.00
702	002436	兴森科技	100	1,032.00	0.00
703	300257	开山股份	100	1,010.00	0.00
704	601456	国联证券	100	964.00	0.00
705	600392	盛和资源	100	862.00	0.00
706	600597	光明乳业	100	777.00	0.00
707	601766	中国中车	100	751.00	0.00
708	600032	浙江新能	100	728.00	0.00
709	601229	上海银行	100	726.00	0.00
710	600023	浙能电力	100	711.00	0.00
711	600019	宝钢股份	100	665.00	0.00
712	002027	分众传媒	100	606.00	0.00
713	600623	华谊集团	100	578.00	0.00
714	600655	豫园股份	100	515.00	0.00
715	000783	长江证券	100	483.00	0.00
716	688082	盛美上海	5	422.55	0.00
717	688521	芯原股份	13	347.75	0.00
718	300591	万里马	100	312.00	0.00
719	603127	昭衍新药	20	265.40	0.00
720	688155	先惠技术	6	237.24	0.00
721	600170	上海建工	96	206.40	0.00
722	603328	依顿电子	23	180.78	0.00

723	688363	华熙生物	3	169.71	0.00
724	688498	源杰科技	1	130.99	0.00
725	688002	睿创微纳	4	111.88	0.00
726	688513	苑东生物	2	100.58	0.00
727	688105	诺唯赞	5	100.05	0.00
728	688180	君实生物	3	87.15	0.00
729	688063	派能科技	2	79.42	0.00
730	000089	深圳机场	12	76.68	0.00
731	688305	科德数控	1	64.46	0.00
732	688234	天岳先进	1	46.92	0.00
733	002985	北摩高科	2	44.06	0.00
734	688100	威胜信息	1	38.15	0.00
735	688166	博瑞医药	1	35.00	0.00
736	002906	华阳集团	1	26.76	0.00
737	688295	中复神鹰	1	20.30	0.00
738	688526	科前生物	1	14.69	0.00
739	300752	隆利科技	1	13.58	0.00
740	300398	飞凯材料	1	12.30	0.00
741	300925	法本信息	1	10.09	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	600276	恒瑞医药	381,261.00	1.03
2	000975	山金国际	342,590.00	0.92
3	002422	科伦药业	340,930.00	0.92
4	600161	天坛生物	317,526.00	0.85
5	002463	沪电股份	308,319.00	0.83
6	601899	紫金矿业	301,084.00	0.81
7	601225	陕西煤业	297,921.00	0.80
8	601288	农业银行	292,852.00	0.79
9	300498	温氏股份	270,581.00	0.73
10	600418	江淮汽车	270,088.00	0.73
11	600060	海信视像	248,220.00	0.67
12	601717	郑煤机	246,953.00	0.66
13	000651	格力电器	239,751.00	0.64
14	000858	五粮液	238,371.00	0.64
15	603997	继峰股份	236,712.00	0.64
16	300679	电连技术	234,605.00	0.63
17	600489	中金黄金	230,383.00	0.62
18	001979	招商蛇口	227,292.00	0.61
19	002475	立讯精密	225,394.00	0.61

20	300308	中际旭创	223,535.00	0.60
----	--------	------	------------	------

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	600276	恒瑞医药	400,125.00	1.08
2	601857	中国石油	369,856.00	0.99
3	601898	中煤能源	340,833.00	0.92
4	600025	华能水电	332,907.00	0.90
5	600418	江淮汽车	311,898.00	0.84
6	601288	农业银行	300,633.00	0.81
7	002463	沪电股份	292,947.00	0.79
8	600066	宇通客车	283,293.00	0.76
9	601225	陕西煤业	280,436.00	0.75
10	601138	工业富联	271,677.00	0.73
11	601899	紫金矿业	271,342.00	0.73
12	600938	中国海油	270,746.00	0.73
13	600161	天坛生物	262,742.00	0.71
14	600188	兖矿能源	257,299.00	0.69
15	601168	西部矿业	256,232.00	0.69
16	000423	东阿阿胶	255,606.00	0.69
17	600048	保利发展	254,464.00	0.68
18	600258	首旅酒店	249,763.00	0.67
19	300363	博腾股份	249,364.00	0.67
20	000975	山金国际	246,167.00	0.66

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	79,522,055.47
卖出股票收入（成交）总额	80,646,907.21

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**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	2,736.95
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,215.60
6	其他应收款	65.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,017.55

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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	225	78,281.34	15,653,463.00	88.87	1,959,838.52	11.13
银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	661	1,483.07	-	-	980,309.30	100.00
合计	886	20,986.02	15,653,463.00	84.19	2,940,147.82	15.81

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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	492,548.48	2.80
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	25,573.14	2.61
	合计	518,121.62	2.79

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	-

负责人持有本开放式基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	10~50
	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C	-
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,400.14	53.79	10,001,400.14	53.79	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	53.79	10,001,400.14	53.79	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华稳健增利灵活配置混合发起式 A	银华稳健增利灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日 (2017 年 12 月 15 日) 基金份额总额	13,175,905.27	1,086,315.48
本报告期期初基金份额总额	17,993,920.11	9,398,602.58
本报告期基金总申购份额	71,667.65	4,994,693.86
减: 本报告期基金总赎回份额	452,286.24	13,412,987.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金	17,613,301.52	980,309.30

份额总额		
------	--	--

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 (%)	
东方财富	7	160,004,465.68	99.90	39,343.56	99.81	-

国泰君安	3	164,497.00	0.10	73.35	0.19	-
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	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	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	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	3	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东方财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证	-	-	-	-	-	-

券						
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

中信证 券	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

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	《银华稳健增利灵活配置混合型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型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型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型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20240630	10,001,400.14	0.00	0.00	10,001,400.14	53.79
	2	20240101-20240630	5,652,062.86	0.00	0.00	5,652,062.86	30.40
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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</p>							

型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 31 日