银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金
2022 年年度报告

2022 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：宁波银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2022 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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11

§4 管理人报告 12

4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 21
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 21

§5 托管人报告 21

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 21
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 21
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 21

§6 审计报告 22

6.1 审计报告基本信息 22
6.2 审计报告的基本内容 22

§7 年度财务报表 24

7.1 资产负债表 24
7.2 利润表 25
7.3 净资产（基金净值）变动表 26
7.4 报表附注 30

§8 投资组合报告 57

8.1 期末基金资产组合情况 57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 57
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 58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 61
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 62
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 62
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 62
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 62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 62
8.12 投资组合报告附注 62

§9 基金份额持有人信息 63

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 63
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 63
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 64

§10 开放式基金份额变动 64

§11 重大事件揭示 65

11.1 基金份额持有人大会决议 65
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 65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 65
11.4 基金投资策略的改变 65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 65
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 65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 66
11.8 其他重大事件 68

§12 影响投资者决策的其他重要信息 71

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 71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 71

§13 备查文件目录 71

13.1 备查文件目录 71
13.2 存放地点 71
13.3 查阅方式 71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	银华盛世精选灵活配置混合发起式	
基金主代码	003940	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 22 日	
基金管理人	银华基金管理股份有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,402,048,985.90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	003940	014047
报告期末下属分级基金的份额总额	2,398,912,454.68 份	3,136,531.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选符合中国经济发展方向上具备利润创造能力，并且估值水平具备竞争力的优势上市公司,追求超越业绩比较基准的投资回报，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置,确定股票、债券、现金的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据、政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。本基金为灵活配置混合型基金，长期来看将以权益性资产为主要配置，同时结合资金面情况、市场情绪面因素，进行短期的战术避险选择。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金。

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	宁波银行股份有限公司
信息披露	姓名	杨文辉	朱广科

负责人	联系电话	(010)58163000	0574-87050338
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody-audit@nbcb.cn
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	0574-83895886
传真		(010)58163027	0574-89103213
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		100738	315100
法定代表人		王珠林	陆华裕

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
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

	2022 年		2021 年	2021 年 11 月 18 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	2020 年	
3.1.1 期间数据和指标	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配

						置混合发起式C
本期已实现收益	-865,798,236.51	-10,096,909.92	1,948,957,458.45	171,961.24	1,935,525,286.09	-
本期利润	-1,200,086,736.11	-17,204,708.10	472,004,579.40	-2,362,918.71	3,186,508,538.99	-
加权平均基金份额本期利润	-0.5005	-0.6989	0.1703	-0.2723	1.0738	-
本期加权平均净值利润率	-23.99%	-33.52%	6.74%	-10.75%	60.32%	-
本期基金份额净值增长率	-19.15%	-19.47%	8.17%	0.36%	80.83%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	2,092,803,472.45	2,710,315.44	3,228,406,921.53	24,681,036.86	1,522,606,669.97	-
期末	0.8724	0.8641	1.2339	1.2334	0.5097	-

可供分配基金份额利润						
期末基金资产净值	4,853,415,892.95	6,318,823.03	6,547,162,205.41	50,064,287.50	6,909,576,223.46	-
期末基金份额净值	2.0232	2.0146	2.5023	2.5018	2.3132	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	186.31%	-19.19%	254.11%	0.36%	227.35%	-

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

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

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人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

银华盛世精选灵活配置混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.31%	1.53%	1.06%	0.58%	-1.37%	0.95%
过去六个月	-12.31%	1.25%	-5.66%	0.52%	-6.65%	0.73%
过去一年	-19.15%	1.52%	-9.39%	0.63%	-9.76%	0.89%

过去三年	58.16%	1.65%	6.47%	0.63%	51.69%	1.02%
过去五年	94.35%	1.58%	12.82%	0.64%	81.53%	0.94%
自基金合同生效起至今	186.31%	1.49%	21.31%	0.60%	165.00%	0.89%

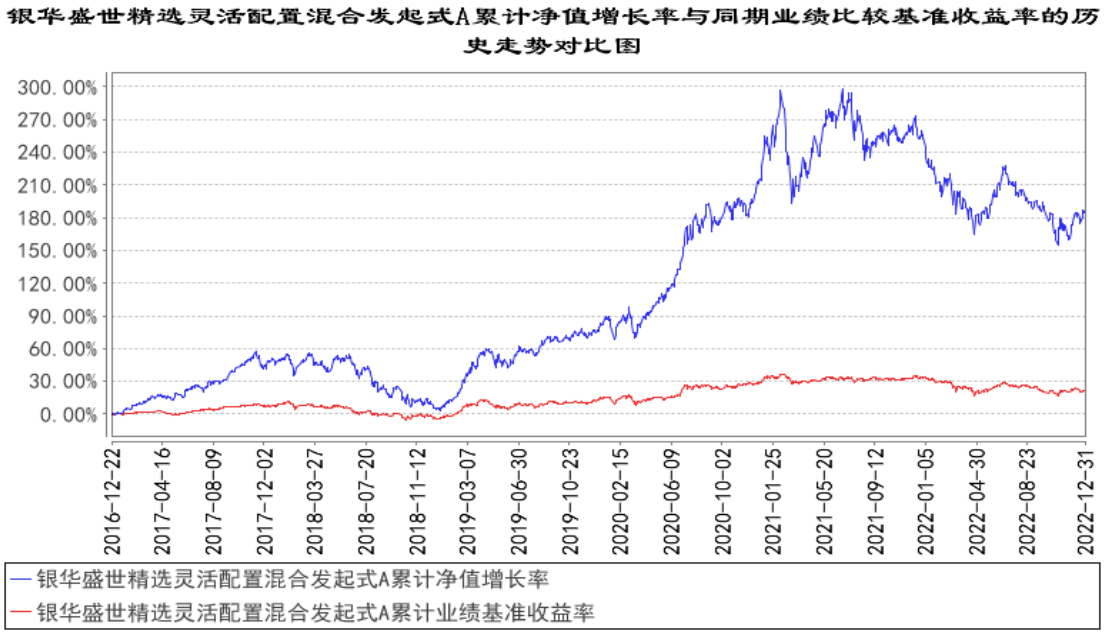
银华盛世精选灵活配置混合发起式 C

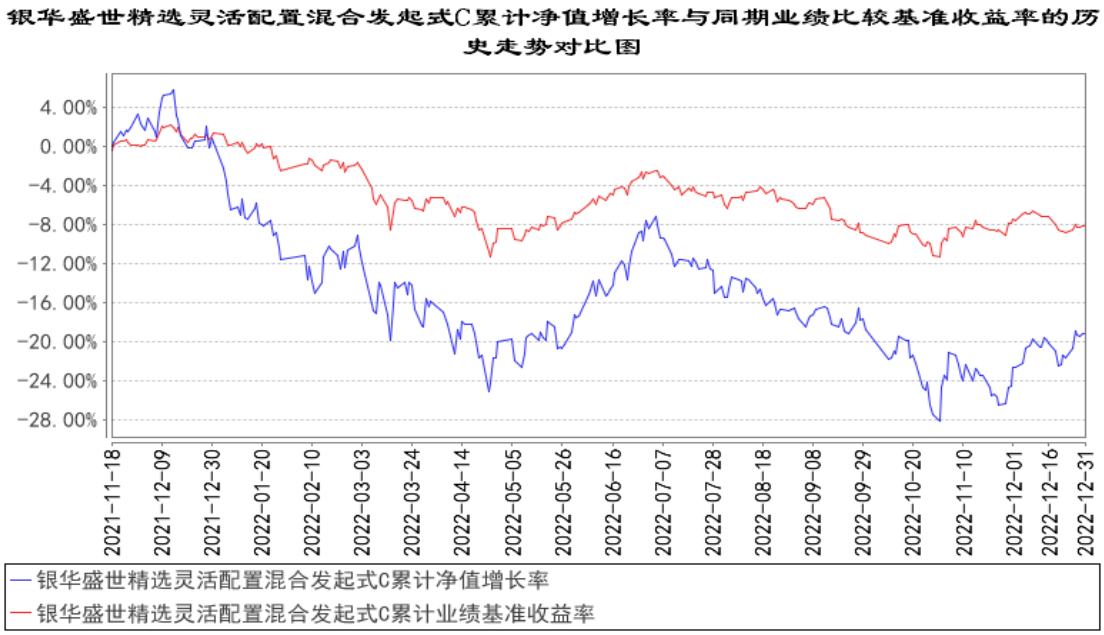
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.42%	1.53%	1.06%	0.58%	-1.48%	0.95%
过去六个月	-12.49%	1.25%	-5.66%	0.52%	-6.83%	0.73%
过去一年	-19.47%	1.52%	-9.39%	0.63%	-10.08%	0.89%
自基金合同生效起至今	-19.19%	1.47%	-8.20%	0.61%	-10.99%	0.86%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，中证 800 指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。具有一定的权威性和市场代表性。因此，中证 800 指数是衡量本基金股票投资业绩的理想基准。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

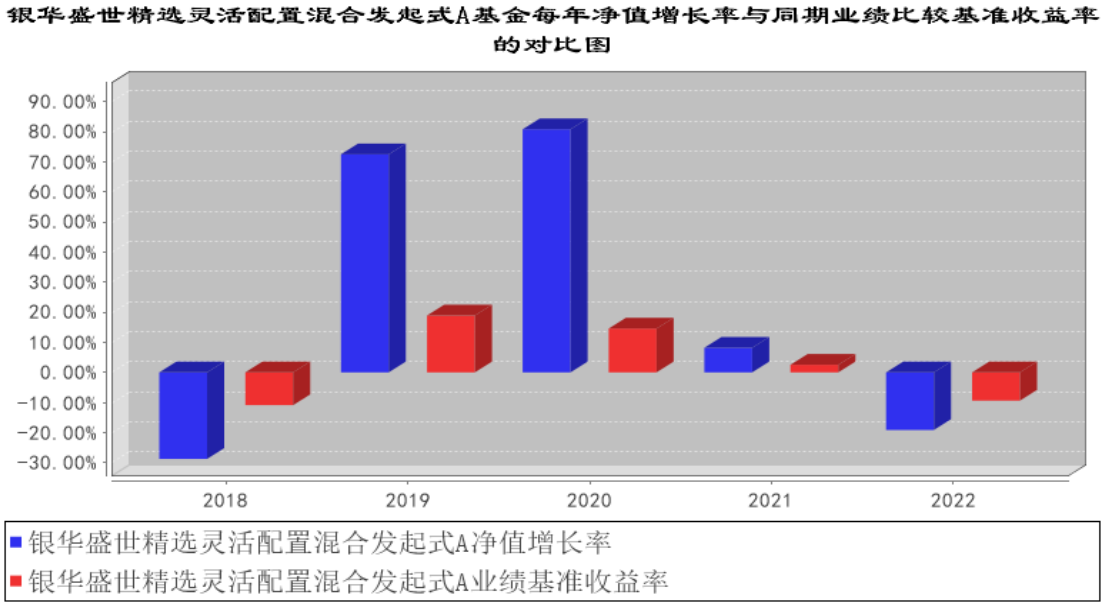
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

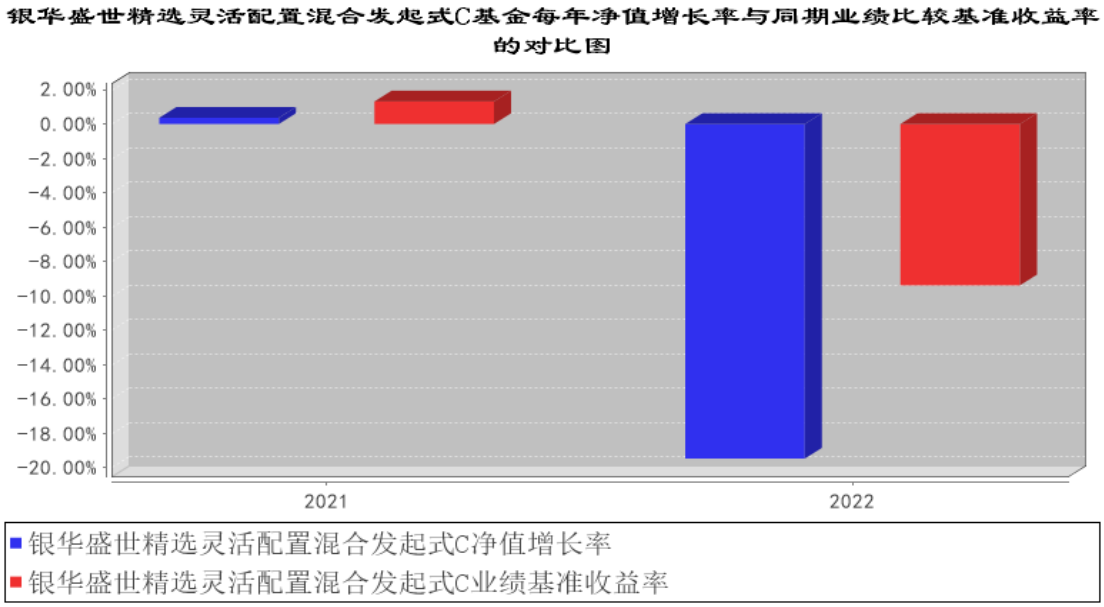




注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有全部权证的市值不得超过基金净资产的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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





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

银华盛世精选灵活配置混合发起式 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	1.6000	362,151,485.91	84,656,562.43	446,808,048.34	-
合计	1.6000	362,151,485.91	84,656,562.43	446,808,048.34	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业有限公司 0.90%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人管理 183 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）、银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资

基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 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发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型

发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金（LOF）、银华华智三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券

投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金。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		
李晓星先生	本基金的基金经理	2016 年 12 月 22 日	-	11.5 年	硕士学位。曾就职于 ABB（中国）有限公司。2011 年 3 月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员、投资管理部基金经理助理、投资管理一部基金经理，现任公司业务副总经理、投资管理一部投资总监、基金经理、投资经理（社保基本养老）、主动型股票投资决策专门委员会联席主席。自 2015 年 7 月 7 日起担任银华中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 12 月 22 日起兼任银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 8 月 11 日至 2020 年 11 月 20 日兼任银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 3 日至 2020 年 9 月 2 日兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 12 日起兼任银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 7 月 5 日起兼任银华心怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 8 月 15 日至 2019 年 9 月 20 日兼任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、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 16 日起兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 1 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 30 日起兼任银华丰享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 8 日起兼任银华心佳两年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 4 日起兼任银华心享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 20 日起兼任银华心兴三年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2022 年 2 月 23 日起兼任银华心选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
张萍女士	本基金的基金经理	2018 年 11 月 6 日	-	12.5 年	硕士学位。曾就职于中信建投证券股份有限公司，于 2015 年 8 月加入银华基金，历任行业研究员、投资经理职务，现任投资管理一部基金经理。自 2018 年 11 月 6 日起担任银华中小盘精选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基金经理，自 2018 年 11 月 6 日至 2020 年 9 月 2 日兼任银华估值优势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基金经理，自 2019 年 3 月 19 日起兼任银华心诚灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 9 月 20 日起兼任银华心怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 16 日至 2022 年 9 月 6 日兼任银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 4 月 1 日至 2022 年 11 月 1 日兼任银华港股通精选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 11 月 11 日起兼任银华品质消费股票型证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 4 日起兼任银华心享一年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 20 日起兼任银华心兴三年持有期混合型证券投资基金基金经理，自 2022 年 2 月 23 日起兼任银华心选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
孙昊	本基金的	2022 年	-	4.5 年	硕士学位。2018 年 7 月加入银华基金，历

天先生	基金经理助理	12 月 18 日			任研究部助理行业研究员、行业研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
梅思寒先生	本基金的基金经理助理	2022 年 12 月 23 日	-	5.5 年	硕士学位。2017 年 6 月加入银华基金，历任研究部助理行业研究员、行业研究员，现任基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、《银华盛世精选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 32 次，原因是量化投资组合和指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场震荡下行，全年来看，价值和周期表现靠前，消费表现居中，科技跌幅居前。我们保持高仓位，配置以消费和医药为主，科技成长为辅，重点配置了食品饮料、消费医疗、新能源、养殖产业链等行业，精选高景气行业中高增长的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华盛世精选灵活配置混合发起式 A 基金份额净值为 2.0232 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.15%；截至本报告期末银华盛世精选灵活配置混合发起式 C 基金份额净值为 2.0146 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.47%；业绩比较基准收益率为-9.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年过去了，国际局势的风云突变，奥密克戎的多点散发，一些灰犀牛板块的预期波动，相信去年对于绝大多数的人来说都是充满挑战的一年，对于二级市场的投资者更是如此。回顾今年的市场，价值和周期板块表现突出，消费底部反转，基本处于市场中游，科技板块整年表现不佳，电子、传媒、计算机、国防军工以及电力设备新能源都是垫底的几个板块。从因子的有效性来说，困境反转因子表现突出，在整体市场信心不足的背景下，市场参与者将绝大部分关注度都放在了边际变化上，行业空间、竞争格局、业绩持续性以及相对估值在股票定价体系中发挥的作用并没有往年的作用大。市场这样的运行结果，跟去年底大部分人的预期是很不一样的，这个也反应了市场的一致预期一般都很难兑现。

权益市场有个特点是往往今年的经验就是明年的教训，今年的教训就是明年的经验。当一个方法被所有人认同的时候，往往就是这个方法要阶段性失效的时候。但如果基金经理可以长期坚持一个有效的办法，那他长期业绩也会是不错的，每种投资方法都会有自己的高光时刻。我们一直坚持的投资方法是景气度投资方法，即选择长期空间大、短期业绩好且估值相对合理的优质公司，赚取业绩增长的钱。景气度投资方法在大多数年份都是有效的，但一般在经济下行周期的末期会阶段性失效。比如 2018 年和 2022 年，因为这个这时候往往伴随着信心的丧失，业绩兑现程度越好的公司，大家反而越会担心未来会下行。我们的持仓总体以消费和医药为主，科技成长为

辅，组合整体表现并没有达到我们的预期，我们持仓的标的基本面的业绩基本都是兑现的，但估值下降的幅度还是远大于业绩增长的速度，这背后的核心就是我们之前讲的市场信心的缺失。

展望 2023 年，我们认为市场信心的恢复是充满希望的，本质是我们认为各项政策措施将在明年有所体现，明年的经济增速会快于今年。我们预计 23 年的 GDP 的增速平稳，财政赤字率基本保持稳定略升，政府的支出以稳为主，地产市场以防风险为主，平台经济逐渐焕发活力，消费复苏可期。总体上来说是以市场化的方式修养生息，消费拉动经济逐步恢复，整体实现社会的高质量发展，同时兼顾安全。我们最为看好成长股方向，继续选择业绩持续兑现的优质公司，看好的方向包括食品饮料、消费医疗、创新药、电动车、光伏、储能、海风、养殖等行业。我们会维持组合的进攻性，努力在 23 年给持有人带来满意的收益率。

消费方面，23 年疫情扰动退去，大消费行业回归基本面选股，复苏是主线，升级和价格弹性标的收益率更高。四季度随着相关政策的变化，消费板块 v 型反转，最先修复的是投资者对于消费复苏的信心，表现为估值的迅速修复，紧接着就是厂商到经销商再到终端全链条的信心恢复，表现为 2023 年目标制定的更加积极、渠道打款备货意愿有所改善，但是基本面的配合需要时间。政策放开后，病例达峰期间消费反而经历了一个更差的阶段，但是复苏的方向是非常明确的。从目前达峰较快的北京、成都等城市看，消费、出行正在以一个非常陡峭的斜率恢复，相信全国各地经济活力的恢复也会逐渐到来，并且随着经济活动的复苏，消费也终究会重新回到升级的趋势上去。因此，我们对全年消费板块保持乐观。配置上仍以业绩确定性高的白酒为主，加仓了部分受益于复苏的食品龙头，以及部分业绩确定性较强、有自身成长性的个股。

医药板块在抗疫需求的带动下，医药板块四季度有了明显的修复。展望 2023 年，我们对医药比 2022 年更乐观一些。伴随着疫情后经济恢复，短期疫情受损的板块，包括严肃医疗和消费医疗，都将迎来边际改善，大部分医药标的都将实现恢复性高增长。对于其中需求旺盛、可择期的医美、医疗服务等，我们预计还会有不错的超额收益。此外，CRO/CDMO 因一级市场投融资数据下滑、地缘政治风险等原因，已经回调了一年半的时间，估值和股价都在低位，对于其中业绩稳定可持续高增的标的，我们继续看好。配置上以消费医疗和 cxo 为主。

新能源方向，22 年由于信心的缺失，尽管相关上市公司大部分的业绩都是处于预期的上限，但估值的杀跌非常严重，如果市场信心有所恢复，估值和业绩的双击值得期待。电动车方面，22 年四季度和 23 年开头这段时间，电动车的基本面并不算特别好，从 10 月开始行业的新接订单出现疲软的迹象，受需求下行、库存高位以及员工感染的多重影响，电动车产业链的公司排产下行比较明显。但我们看到股价已经先行调整了一整年，悲观预期大部分都得到了体现。展望 2023 年，美国市场会迎来较好的增长，国内和欧洲的销量预期都会迎来修复，这个股价位置孕育了一

些机会。我们会更多聚焦在上游资源、差异化较大的电池以及贴近消费者能留存住利润的整车标的。中游材料大规模扩产，我们会持续关注竞争格局的变化，聚焦盈利能力有所提升的环节。

光伏方面，硅料产能的扩张带动产业链价格快速下行，虽然还有个别辅材阶段性出现紧缺的情况，但整体看供给端的约束不大，2023 年光伏装机量快速增长的逻辑得到进一步增强。除了量的增长，上半年一体化公司的单位盈利也会有较好的表现，除此之外我们看好新技术带来的盈利溢价、受益于量增的逆变器和辅材链以及下游绿电运营商。

风电方面，22 年国内招标量创历史新高，欧美海上风电的年化增速开始上修，23 年的装机增速值得期待，但招标转化为业绩的时间会比市场乐观预期的要长，21 年下半年新签的低价订单开始交付，产业链的盈利可能没有想象中好，整体板块的机会没那么突出。其中海上风电、海外出口以及国产替代链条核心环节的业绩增速以及持续性值得我们做持续性的布局。

储能方面，行业整体仍然处于爆发期，22 年的估值走在盈利前面，客观上增加了投资的难度。近期的股价调整提升了相关公司一定的性价比，在高预期的背景下，相关公司的业绩增速值得跟踪研究，回避业绩低预期概率大的公司。细分来看海外户储美洲市场增长更快，大储国内市场增长更快。基本上国外销售向消费品变化，国内项目承担较多的调峰任务。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配。

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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	德师报(审)字(23)第 P01523 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	银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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，我们独立于银华盛世精选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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错

	报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督银华盛世精选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	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。 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： (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。 (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。 (3) 评价基金管理人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。 (4)对基金管理人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，就可能导致对银华盛世精选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盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。 (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。 我们与基金管理人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。
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	韩 玫 丁 慧
会计师事务所的地址	中国 上海

审计报告日期	2023 年 03 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	353,354,435.62	494,373,701.40
结算备付金		9,719,920.04	12,674,700.19
存出保证金		2,464,565.82	4,036,364.13
交易性金融资产	7.4.7.2	4,470,396,790.75	6,070,730,845.46
其中：股票投资		4,470,396,790.75	6,070,730,845.46
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		37,305,971.43	138,559,940.67
应收股利		-	-
应收申购款		2,822,030.10	25,427,944.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	167,393.24
资产总计		4,876,063,713.76	6,745,970,889.72
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022 年 12 月 31 日**	**上年度末 2021 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		670,875.92	59,229,441.83

应付赎回款		2,577,649.42	73,080,348.10
应付管理人报酬		6,066,994.82	8,588,775.72
应付托管费		1,011,165.77	1,431,462.63
应付销售服务费		2,602.07	9,906.13
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	5,999,709.78	6,404,462.40
负债合计		16,328,997.78	148,744,396.81
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	2,402,048,985.90	2,636,422,904.59
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,457,685,730.08	3,960,803,588.32
净资产合计		4,859,734,715.98	6,597,226,492.91
负债和净资产总计		4,876,063,713.76	6,745,970,889.72

注： 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额为 2,402,048,985.90 份，其中银华盛世精选灵活配置混合发起式 A 基金份额 2,398,912,454.68 份，基金份额净值为人民币 2.0232 元；银华盛世精选灵活配置混合发起式 C 基金份额 3,136,531.22 份，基金份额净值为人民币 2.0146 元。

7.2 利润表

会计主体：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,128,257,615.76	636,389,650.27
1.利息收入		4,759,072.48	7,270,111.16
其中：存款利息收入	7.4.7.13	4,759,072.48	7,270,111.12
债券利息收入		-	0.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-794,625,608.10	2,081,952,797.88
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-840,965,310.36	2,057,759,251.34
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.15	1,118,650.84	54.70
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
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	45,221,051.42	24,193,491.84
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	-341,396,297.78	-1,479,487,759.00
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	3,005,217.64	26,654,500.23
减：二、营业总支出		89,033,828.45	166,747,989.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	75,948,671.69	102,656,043.45
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,658,112.01	17,109,340.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	207,033.03	9,909.81
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		11.72	-
8. 其他费用	7.4.7.23	220,000.00	46,972,695.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,217,291,444.21	469,641,660.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,217,291,444.21	469,641,660.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,217,291,444.21	469,641,660.69

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	2,636,422,904.59	-	3,960,803,588.32	6,597,226,492.91
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,636,422,904.59	-	3,960,803,588.32	6,597,226,492.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-234,373,918.69	-	-1,503,117,858.24	-1,737,491,776.93
(一)、综合收益总额	-	-	-1,217,291,444.21	-1,217,291,444.21
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-234,373,918.69	-	-285,826,414.03	-520,200,332.72
其中:1.基金申购款	812,055,999.32	-	896,087,999.56	1,708,143,998.88
2.基金赎回款	-1,046,429,918.01	-	-1,181,914,413.59	-2,228,344,331.60
(三)、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,402,048,985.90	-	2,457,685,730.08	4,859,734,715.98
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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(基金净值)	2,986,985,585.45	-	3,922,590,638.01	6,909,576,223.46
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,986,985,585.45	-	3,922,590,638.01	6,909,576,223.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-350,562,680.86	-	38,212,950.31	-312,349,730.55
(一)、综合收益总额	-	-	469,641,660.69	469,641,660.69

（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-350,562,680.86	-	-431,428,710.38	-781,991,391.24
其中：1.基金申购款	5,778,633,389.92	-	4,610,078,764.44	10,388,712,154.36
2.基金赎回款	-6,129,196,070.78	-	-5,041,507,474.82	-11,170,703,545.60
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,636,422,904.59	-	3,960,803,588.32	6,597,226,492.91

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

银华盛世精选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【2016】2738 号文《关于准予银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册并公开发行，由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及有关规定和《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起，于 2016 年 12 月 12 日至 2016 年 12 月 16 日向社会公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限为不定期，募集期间净认购资金总额为人民币 21,802,102.62 元，在募集期间产生的利息为人民币 2,007.61 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 21,804,110.23 元，折合 21,804,110.23 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所验证。经向中国证监会备案后，基金合同于 2016 年 12 月 22 日生效。本基金的基金管理人和注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《银华基金管理股份有限公司关于旗下银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，为更好地满足广大投资人的理财需求，本基金管理人经与基金托管人宁波银行股份有限公司协商一致，决定自 2021 年 11 月 18 日起对本基金增设 C 类基金份额，据此对本基金的基金合同、托管协议做相应修改。本基金的原有基金份额全部转为 A 类基金份额。

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 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包含国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存

款及其他银行存款)、现金、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)；本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，其余资产投资于债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金、权证、股指期货等金融工具；本基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准是：中证 800 指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1.金融资产分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将

该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2. 金融负债分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的

损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，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)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大

程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

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，且目前可执行该种法定权利，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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2)投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券

价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3)公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4)信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

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)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类别基金份额净值减去每单位该类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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6 号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《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》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3)根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24 号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0 元。本基金执行新金融工具准则的影响如下：

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 494,373,701.40 元，按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 494,532,822.53 元，其中应收利息人民币 159,121.13 元，重新计量的预期信用损失准备人民币 0 元。

于 2021 年 12 月 31 日，结算备付金按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,674,700.19 元，按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 12,680,974.26 元，其中应收利息人民币 6,274.07 元，重新计量的预期信用损失准备人民币 0 元。

于 2021 年 12 月 31 日，存出保证金按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,036,364.13 元，按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 4,038,362.17 元，其中应收利息人民币 1,998.04 元，重新计量的预期信用损失准备人民币 0 元。

于 2021 年 12 月 31 日，交易性金融资产按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,070,730,845.46 元，按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 6,070,730,845.46 元，其中应收利息人民币 0 元。

于 2021 年 12 月 31 日，应收利息按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 167,393.24 元，按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 0 元，其中转出至银行存款人民币 159,121.13 元，转出至结算备付金为人民币 6,274.07 元，转出至存出保证金人民币 1,998.04 元，转出至交易性金融资产人民币 0 元，转出至应收申购款人民币 0 元。

于 2021 年 12 月 31 日，应收申购款按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 25,427,944.63 元，按照新金融工具准则列示的 2022 年 1 月 1 日账面价值为人民币 25,427,944.63 元，其中应收利息人民币 0 元，重新计量的预期信用损失准备人民币 0 元。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增

值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税；

(2)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，暂不缴纳企业所得税；

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	353,354,435.62	494,373,701.40
等于：本金	353,214,651.22	494,373,701.40
加：应计利息	139,784.40	-
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	353,354,435.62	494,373,701.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,539,322,344.17	-	4,470,396,790.75	-68,925,553.42
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		4,539,322,344.17	-	4,470,396,790.75	-68,925,553.42
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,798,260,101.10	-	6,070,730,845.46	272,470,744.36
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		5,798,260,101.10	-	6,070,730,845.46	272,470,744.36

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

7.4.7.5 债权投资

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

注：无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	167,393.24
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	167,393.24

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,441.49	150,091.88
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	5,775,268.29	6,034,370.52
其中：交易所市场	5,775,268.29	6,034,370.52
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
合计	5,999,709.78	6,404,462.40

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华盛世精选灵活配置混合发起式 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,616,411,667.14	2,616,411,667.14
本期申购	789,186,870.92	789,186,870.92
本期赎回（以“-”号填列）	-1,006,686,083.38	-1,006,686,083.38
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	2,398,912,454.68	2,398,912,454.68

银华盛世精选灵活配置混合发起式 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,011,237.45	20,011,237.45
本期申购	22,869,128.40	22,869,128.40
本期赎回（以“-”号填列）	-39,743,834.63	-39,743,834.63
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	3,136,531.22	3,136,531.22

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

银华盛世精选灵活配置混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,228,406,921.53	702,343,616.74	3,930,750,538.27
本期利润	-865,798,236.51	-334,288,499.60	-1,200,086,736.11
本期基金份额交易产生的变动数	-269,805,212.57	-6,355,151.32	-276,160,363.89
其中：基金申购款	817,369,240.40	52,243,321.68	869,612,562.08
基金赎回款	-1,087,174,452.97	-58,598,473.00	-1,145,772,925.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,092,803,472.45	361,699,965.82	2,454,503,438.27

银华盛世精选灵活配置混合发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	24,681,036.86	5,372,013.19	30,053,050.05
本期利润	-10,096,909.92	-7,107,798.18	-17,204,708.10
本期基金份额交易产生的变动数	-11,873,811.50	2,207,761.36	-9,666,050.14
其中：基金申购款	23,041,448.25	3,433,989.23	26,475,437.48
基金赎回款	-34,915,259.75	-1,226,227.87	-36,141,487.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,710,315.44	471,976.37	3,182,291.81

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

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,570,725.01	6,990,820.12
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	147,698.79	208,976.46
其他	40,648.68	70,314.54
合计	4,759,072.48	7,270,111.12

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-840,965,310.36	2,057,759,251.34
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	-840,965,310.36	2,057,759,251.34

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	14,503,542,297.19	17,405,388,510.40
减：卖出股票成本总额	15,304,527,176.55	15,347,629,259.06
减：交易费用	39,980,431.00	-
买卖股票差价收入	-840,965,310.36	2,057,759,251.34

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	3,231.19	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,115,419.65	54.70
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	1,118,650.84	54.70

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,091,752.90	354.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,973,000.00	300.00
减：应计利息总额	3,328.96	0.08
减：交易费用	4.29	-
买卖债券差价收入	1,115,419.65	54.70

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

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	45,221,051.42	24,193,491.84
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	45,221,051.42	24,193,491.84

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-341,396,297.78	-1,479,487,759.00
股票投资	-341,396,297.78	-1,479,487,677.46
债券投资	-	-81.54
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	-341,396,297.78	-1,479,487,759.00

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,793,834.22	25,126,310.12
基金转换费收入	211,383.42	1,528,190.11
合计	3,005,217.64	26,654,500.23

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
交易费用	-	46,752,695.63
合计	220,000.00	46,972,695.63

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、基金代销机构
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	基金管理人、基金销售机构
宁波银行股份有限公司(“宁波银行”)	基金托管人、基金代销机构
银华长安资本管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	75,948,671.69	102,656,043.45
其中：支付销售机构的客户维护费	25,886,938.66	27,908,128.74

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,658,112.01	17,109,340.69

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付，支付日期顺延。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	146,184.98	146,184.98
合计	-	146,184.98	146,184.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	9,569.73	9,569.73
合计	-	9,569.73	9,569.73

注：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 0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.4%÷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

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（ 2016 年 12 月 22 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	10,001,200.12	-
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	10,001,200.12	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.42%	-
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 11 月 18 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（ 2016 年 12 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,200.12	-
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	10,001,200.12	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%	-

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：本基金的基金管理人运用固有资金作为发起资金于基金募集期间认购了本基金银华盛世精选灵活配置混合型发起式的基金份额，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不低于三年。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
宁波银行	353,354,435.62	4,570,725.01	494,373,701.40	6,990,820.12

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2022 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301176	逸豪新材	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301223	中荣股份	2022 年 10 月 13 日	6 个月	新股流通受限	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
301227	森鹰窗业	2022 年 9 月 16 日	6 个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301319	唯特偶	2022 年 9 月 22 日	6 个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301366	一博科技	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
603866	桃李面包	2022 年 11 月 17 日	6 个月	大宗交易流通受限	12.55	14.58	1,830,000	22,966,500.00	26,681,400.00	-

注：1：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

2：根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	353,354,435.62	-	-	-	353,354,435.62
结算备付金	9,719,920.04	-	-	-	9,719,920.04
存出保证金	2,464,565.82	-	-	-	2,464,565.82
交易性金融资产	-	-	-	4,470,396,790.75	4,470,396,790.75
应收申购款	-	-	-	2,822,030.10	2,822,030.10
应收清算款	-	-	-	37,305,971.43	37,305,971.43
资产总计	365,538,921.48	-	-	4,510,524,792.28	4,876,063,713.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,577,649.42	2,577,649.42
应付管理人报酬	-	-	-	6,066,994.82	6,066,994.82
应付托管费	-	-	-	1,011,165.77	1,011,165.77
应付清算款	-	-	-	670,875.92	670,875.92
应付销售服务费	-	-	-	2,602.07	2,602.07
其他负债	-	-	-	5,999,709.78	5,999,709.78
负债总计	-	-	-	16,328,997.78	16,328,997.78
利率敏感度缺口	365,538,921.48	-	-	4,494,195,794.50	4,859,734,715.98
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	494,373,701.40	-	-	-	494,373,701.40
结算备付金	12,674,700.19	-	-	-	12,674,700.19
存出保证金	4,036,364.13	-	-	-	4,036,364.13
交易性金融资产	-	-	-	6,070,730,845.46	6,070,730,845.46
应收申购款	-	-	-	25,427,944.63	25,427,944.63
应收证券清算款	-	-	-	138,559,940.67	138,559,940.67
其他资产	-	-	-	167,393.24	167,393.24
资产总计	511,084,765.72	-	-	6,234,886,124.00	6,745,970,889.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	73,080,348.10	73,080,348.10
应付管理人报酬	-	-	-	8,588,775.72	8,588,775.72
应付托管费	-	-	-	1,431,462.63	1,431,462.63
应付证券清算款	-	-	-	59,229,441.83	59,229,441.83
应付销售服务费	-	-	-	9,906.13	9,906.13
其他负债	-	-	-	6,404,462.40	6,404,462.40
负债总计	-	-	-	148,744,396.81	148,744,396.81
利率敏感度缺口	511,084,765.72	-	-	6,086,141,727.19	6,597,226,492.91

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：本基金本报告期末及上年度末（如有）未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

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

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	4,470,396,790.75	91.99	6,070,730,845.46	92.02
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	4,470,396,790.75	91.99	6,070,730,845.46	92.02

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末 （2021 年 12 月

			31 日 ）
分析	业绩比较基准上升 5%	488,101,705.76	902,817,747.38
	业绩比较基准下降 5%	-488,101,705.76	-902,817,747.38

7.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1、假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	2、用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	3、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	风险价值（单位：人民币元）	本期末 （2022 年 12 月 31 日）	上年度末 （2021 年 12 月 31 日 ）
	1.业绩比较基准上升 5%	488,101,705.76	902,817,747.38
	2.业绩比较基准下降 5%	-488,101,705.76	-902,817,747.38
	合计	-	-

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	4,443,664,841.31	6,068,025,963.15
第二层次	-	5,504.49

第三层次	26,731,949.44	2,699,377.82
合计	4,470,396,790.75	6,070,730,845.46

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,699,377.82	2,699,377.82
当期购买	-	23,034,776.97	23,034,776.97
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,878,878.66	2,878,878.66
当期利得或损失总额	-	3,876,673.31	3,876,673.31
其中：计入损益的利得或损失	-	3,876,673.31	3,876,673.31
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	26,731,949.44	26,731,949.44
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	3,697,172.47	3,697,172.47
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	127,888,280.26	127,888,280.26
当期购买	-	2,354,347.37	2,354,347.37
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-

转出第三层次	-	131,494,032.04	131,494,032.04
当期利得或损失总额	-	3,950,782.23	3,950,782.23
其中：计入损益的利得或损失	-	3,950,782.23	3,950,782.23
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,699,377.82	2,699,377.82
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	345,030.45	345,030.45

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	26,731,949.44	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2783-0.7544	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	2,699,377.82	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1717-2.7417	负相关

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

无。

7.4.16 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 29 日经本基金管理人批准报出。

§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	4,470,396,790.75	91.68
	其中：股票	4,470,396,790.75	91.68
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	363,074,355.66	7.45
8	其他各项资产	42,592,567.35	0.87
9	合计	4,876,063,713.76	100.00

注：由于四舍五入的原因，市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

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	139,631,684.14	2.87
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,998,461,907.60	82.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	126,854,161.20	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,127,481.17	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	95,851,646.88	1.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,409.36	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,461,500.40	2.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,470,396,790.75	91.99

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	1,666,413	373,743,107.64	7.69
2	600809	山西汾酒	1,286,443	366,623,390.57	7.54
3	600519	贵州茅台	200,881	346,921,487.00	7.14
4	300896	爱美客	377,316	213,692,916.60	4.40
5	603345	安井食品	1,149,767	186,124,281.96	3.83
6	002311	海大集团	2,392,058	147,661,740.34	3.04
7	300122	智飞生物	1,611,008	141,494,832.64	2.91
8	300498	温氏股份	7,113,178	139,631,684.14	2.87
9	000596	古井贡酒	509,272	135,924,696.80	2.80
10	000963	华东医药	2,710,559	126,854,161.20	2.61
11	002459	晶澳科技	1,934,133	116,222,051.97	2.39
12	002594	比亚迪	449,983	115,632,131.51	2.38
13	300957	贝泰妮	770,735	115,024,491.40	2.37
14	002049	紫光国微	768,805	101,343,875.10	2.09
15	300015	爱尔眼科	3,257,760	101,218,603.20	2.08
16	603456	九洲药业	2,296,107	97,423,820.01	2.00
17	601888	中国中免	443,696	95,851,646.88	1.97
18	605117	德业股份	273,000	90,417,600.00	1.86
19	300725	药石科技	956,303	76,982,391.50	1.58
20	300014	亿纬锂能	871,807	76,631,835.30	1.58
21	688032	禾迈股份	80,930	75,843,549.50	1.56
22	688348	昱能科技	130,993	74,469,520.50	1.53
23	300760	迈瑞医疗	227,302	71,820,612.94	1.48
24	688599	天合光能	1,004,829	64,067,897.04	1.32
25	688223	晶科能源	4,047,438	59,294,966.70	1.22
26	688439	振华风光	460,234	54,712,617.92	1.13
27	600298	安琪酵母	1,198,191	54,182,197.02	1.11
28	002865	钧达股份	284,553	52,670,760.30	1.08
29	688385	复旦微电	731,576	51,071,320.56	1.05
30	603866	桃李面包	3,396,280	50,802,112.00	1.05

31	300750	宁德时代	127,043	49,981,257.06	1.03
32	300595	欧普康视	1,342,700	47,934,390.00	0.99
33	300438	鹏辉能源	610,221	47,591,135.79	0.98
34	688041	海光信息	1,175,712	47,169,565.44	0.97
35	300763	锦浪科技	249,600	44,940,480.00	0.92
36	688050	爱博医疗	187,938	43,357,296.60	0.89
37	603369	今世缘	819,200	41,697,280.00	0.86
38	688120	华海清科	169,306	38,017,662.30	0.78
39	002371	北方华创	168,416	37,944,124.80	0.78
40	688363	华熙生物	256,893	34,752,485.04	0.72
41	603170	宝立食品	1,188,388	33,667,032.04	0.69
42	603027	千禾味业	1,520,376	31,593,413.28	0.65
43	603517	绝味食品	391,300	23,904,517.00	0.49
44	688596	正帆科技	659,690	22,396,475.50	0.46
45	600522	中天科技	964,600	15,578,290.00	0.32
46	002025	航天电器	224,786	14,892,072.50	0.31
47	002557	洽洽食品	294,042	14,702,100.00	0.30
48	600702	舍得酒业	90,700	14,437,626.00	0.30
49	605111	新洁能	154,399	11,978,274.42	0.25
50	002837	英维克	346,700	11,548,577.00	0.24
51	300973	立高食品	108,159	10,402,732.62	0.21
52	688503	聚和材料	69,659	10,386,853.49	0.21
53	688311	盟升电子	123,785	10,053,817.70	0.21
54	300132	青松股份	1,174,900	8,189,053.00	0.17
55	600872	中炬高新	218,400	8,052,408.00	0.17
56	600132	重庆啤酒	45,100	5,744,838.00	0.12
57	002531	天顺风能	378,100	5,720,653.00	0.12
58	301239	普瑞眼科	74,262	5,242,897.20	0.11
59	300645	正元智慧	101,800	2,563,324.00	0.05
60	688111	金山办公	2,133	564,157.17	0.01
61	688475	萤石网络	20,526	532,239.18	0.01
62	688231	隆达股份	8,014	286,260.08	0.01
63	688270	臻镭科技	800	92,776.00	0.00
64	600600	青岛啤酒	609	65,467.50	0.00
65	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
66	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
67	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
68	000888	峨眉山 A	888	8,409.36	0.00
69	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
70	301319	唯特偶	115	6,126.05	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	300750	宁德时代	484,211,621.25	7.34
2	000596	古井贡酒	464,792,005.56	7.05
3	002594	比亚迪	406,700,634.32	6.16
4	600809	山西汾酒	395,208,251.42	5.99
5	000568	泸州老窖	342,181,768.56	5.19
6	601012	隆基绿能	332,241,116.37	5.04
7	000858	五 粮 液	282,912,050.94	4.29
8	300122	智飞生物	273,688,319.04	4.15
9	000963	华东医药	254,604,580.81	3.86
10	600887	伊利股份	248,249,760.14	3.76
11	002271	东方雨虹	247,446,723.94	3.75
12	002371	北方华创	215,173,221.72	3.26
13	605117	德业股份	206,126,780.86	3.12
14	002049	紫光国微	204,344,346.38	3.10
15	600702	舍得酒业	197,829,599.45	3.00
16	002311	海大集团	188,319,192.07	2.85
17	601888	中国中免	179,590,815.76	2.72
18	603198	迎驾贡酒	177,267,891.31	2.69
19	600132	重庆啤酒	177,166,325.73	2.69
20	300896	爱美客	173,917,341.85	2.64
21	600690	海尔智家	172,401,409.82	2.61
22	600905	三峡能源	170,534,861.83	2.58
23	603369	今世缘	162,540,852.03	2.46
24	002557	洽洽食品	161,577,674.35	2.45
25	002865	钧达股份	159,342,110.78	2.42
26	002459	晶澳科技	153,398,156.61	2.33
27	300498	温氏股份	148,407,404.29	2.25
28	603345	安井食品	148,023,638.78	2.24
29	002179	中航光电	145,019,020.51	2.20
30	600519	贵州茅台	140,231,732.62	2.13
31	603456	九洲药业	138,326,592.18	2.10
32	688041	海光信息	134,010,661.66	2.03

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	300750	宁德时代	684,955,071.44	10.38
2	000858	五 粮 液	561,362,793.15	8.51
3	600887	伊利股份	497,394,009.67	7.54
4	600809	山西汾酒	479,825,683.44	7.27

5	603259	药明康德	413,270,258.19	6.26
6	300122	智飞生物	400,278,011.06	6.07
7	002594	比亚迪	358,119,537.11	5.43
8	000596	古井贡酒	345,966,275.48	5.24
9	601012	隆基绿能	317,568,914.63	4.81
10	600702	舍得酒业	303,126,639.99	4.59
11	600132	重庆啤酒	279,468,539.96	4.24
12	002271	东方雨虹	273,677,237.43	4.15
13	000792	盐湖股份	247,913,000.96	3.76
14	002304	洋河股份	230,039,713.15	3.49
15	600519	贵州茅台	211,787,654.31	3.21
16	601899	紫金矿业	208,215,411.84	3.16
17	000568	泸州老窖	191,728,174.57	2.91
18	002821	凯莱英	191,523,031.32	2.90
19	603198	迎驾贡酒	172,438,715.48	2.61
20	600905	三峡能源	171,257,366.87	2.60
21	603369	今世缘	168,890,073.29	2.56
22	002371	北方华创	162,808,101.36	2.47
23	600690	海尔智家	160,976,423.54	2.44
24	688111	金山办公	159,428,709.95	2.42
25	300760	迈瑞医疗	156,674,980.49	2.37
26	002466	天齐锂业	151,923,568.50	2.30
27	300666	江丰电子	150,740,690.25	2.28
28	002557	洽洽食品	150,724,666.70	2.28
29	300725	药石科技	150,268,822.15	2.28
30	002179	中航光电	149,545,757.05	2.27
31	688116	天奈科技	148,439,083.35	2.25
32	603127	昭衍新药	140,281,187.83	2.13
33	603517	绝味食品	136,978,384.99	2.08
34	002311	海大集团	134,877,764.91	2.04
35	000963	华东医药	134,615,349.55	2.04

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	14,045,589,419.62
卖出股票收入（成交）总额	14,503,542,297.19

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

本基金本报告期未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期未投资国债期货。

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	2,464,565.82
2	应收清算款	37,305,971.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,822,030.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,592,567.35

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股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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（%）
银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	235,248	10,197.38	420,689,473.26	17.54	1,978,222,981.42	82.46
银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	928	3,379.88	731,841.35	23.33	2,404,689.87	76.67
合计	236,176	10,170.59	421,421,314.61	17.54	1,980,627,671.29	82.46

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	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	4,484,743.03	0.19
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	6,621.38	0.21
	合计	4,491,364.41	0.19

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	10~50
	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	>100

	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C	0
	合计	>100

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	10,001,200.12	0.42	10,001,200.12	0.42	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	10,001,200.12	0.42	10,001,200.12	0.42	3 年

注:截至本报告期末,基金管理人持有本基金份额 10,001,200.12 份,其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 1,200.12 份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华盛世精选灵活配置混合发起式 A	银华盛世精选灵活配置混合发起式 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 22 日）基金份额总额	21,804,110.23	-
本报告期期初基金份额总额	2,616,411,667.14	20,011,237.45
本报告期基金总申购份额	789,186,870.92	22,869,128.40
减：本报告期基金总赎回份额	1,006,686,083.38	39,743,834.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,398,912,454.68	3,136,531.22

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

2022 年 3 月 1 日，本基金管理人发布关于首席信息官任职的公告，经本基金管理人董事会批准，张轶先生自 2022 年 2 月 28 日起担任本基金管理人首席信息官职务。

2022 年 8 月 30 日，本基金管理人发布关于公司高级管理人员变更的公告，经本基金管理人董事会批准，公司总经理王立新先生自 2022 年 8 月 28 日起代任本基金管理人首席信息官职务。张轶先生自 2022 年 8 月 28 日起不再担任本基金管理人首席信息官职务。

2022 年 10 月 14 日，本基金管理人发布关于公司高级管理人员变更的公告，郑蓓雷女士自 2022 年 10 月 13 日起担任本基金管理人财务负责人职务，王勇先生自 2022 年 10 月 13 日起担任本基金管理人董事会秘书职务。

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，基金托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十。

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

本报告期由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，报告期内本基金应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬共计人民币 100,000.00 元。目前的审计机构已连续 6 年为本基金提供审计服务。

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

措施	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	银华基金管理股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 11 月 24 日

采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	出具警示函（行政监管措施）
受到稽查或处罚等措施的原因	公司在内控管理、销售业务管理中，违反了《证券投资基金管理公司管理办法》（证监会令第 22 号）第四十五条、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（证监会令第 175 号）第三十条第一项规定。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。公司所有业务均正常开展。
其他	无。

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(%)	
中信证券	6	15,001,905,504.83	52.57	13,064,472.91	56.52	-
光大证券	3	3,364,988,423.69	11.79	2,510,869.66	10.86	-
天风证券	2	2,687,978,942.09	9.42	1,965,717.15	8.50	-
国泰君安	2	2,668,739,289.90	9.35	1,951,645.46	8.44	-
广发证券	2	2,286,461,937.18	8.01	1,672,424.73	7.23	-
东吴证券	2	2,022,102,199.72	7.09	1,478,754.64	6.40	-
安信证券	4	366,414,186.01	1.28	341,243.29	1.48	-
中银国际	2	140,612,864.24	0.49	130,950.01	0.57	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	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。

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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	4,729,836.60	92.89	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	361,916.30	7.11	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 1 月 21 日
2	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 21 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金增加广发证券股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,上海证券报	2022 年 1 月 28 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金增加中国民生银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,上海证券报	2022 年 2 月 10 日
5	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 2 月 11 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,上海证券报	2022 年 2 月 14 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大河财富基金销售有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,中国证券报,上海证券报	2022 年 2 月 17 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 2 月 25 日
9	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书更新(2022 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	2022 年 2 月 25 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于增加中原证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,上海证券报,证券时报	2022 年 2 月 25 日
11	《银华盛世精选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	2022 年 2 月 25 日
12	《银华基金管理股份有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,三大证券报	2022 年 3 月 4 日

13	《银华基金管理股份有限公司关于增加东方财富证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 3 月 14 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 3 月 23 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 3 月 25 日
16	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2021 年年度报告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 29 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 3 月 29 日
18	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 20 日
19	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 4 月 20 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,三大证券报	2022 年 4 月 28 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 5 月 11 日
22	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,三大证券报	2022 年 6 月 14 日
23	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,三大证券报	2022 年 7 月 5 日
24	《银华基金管理股份有限公司关于银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金增加东莞银行股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,上海证券报	2022 年 7 月 6 日
25	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 7 月 13 日
26	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,上海证券报,证券	2022 年 7 月 15 日

		时报,证券日报	
27	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 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	2022 年 7 月 19 日
28	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 7 月 19 日
29	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 7 月 19 日
30	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 8 月 4 日
31	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书更新(2022 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	2022 年 8 月 5 日
32	《银华盛世精选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	2022 年 8 月 5 日
33	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 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	2022 年 8 月 29 日
34	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2022 年 8 月 29 日
35	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 8 月 29 日
36	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,三大证券报	2022 年 9 月 1 日
37	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 9 月 7 日
38	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 9 月 8 日
39	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2022 年 9 月 22 日
40	《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 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	2022 年 10 月 25 日
41	《银华基金管理股份有限公司旗下部	四大证券报	2022 年 10 月 25 日

	分基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告》		

§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

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2022 年 2 月 25 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所上市股票及相关风险揭示的公告》，本基金自 2022 年 2 月 25 日起可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票，基金资产并非必然投资于北交所股票。基金资产投资于北交所股票的特有风险包括但不限于上市公司经营风险、市场风险、股价大幅波动风险、流动性风险、转板风险、退市风险、系统性风险、集中度风险、政策风险和监管规则变化风险等。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 银华盛世精选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《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》

13.1.3《银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

13.1.4《银华盛世精选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

2023 年 3 月 31 日