

银华核心价值优选混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45

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	45
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华核心价值优选混合型证券投资基金
基金简称	银华价值优选混合
基金主代码	519001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 9 月 27 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,097,188,878.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司,同时通过优化风险收益配比以获取超额收益,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	在价值创造主导的投资理念指导下,本基金的投资策略以自下而上的股票精选为主,同时也通过辅助性的主动类别资产配置,在投资组合中加入债券资产以降低整个资产组合的系统性风险。本基金充分发挥“自下而上”的主动选股能力,通过定量的业绩归因分析深入发掘主动性回报的相关信息,适当加大选股因素的贡献度,借助投资组合优化技术实现投资风险与收益的最佳配比。 本基金的具体投资比例如下:股票投资比例浮动范围:60%-95%;除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为5%-40%,其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于5%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,其与预期收益和预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。本基金力争在控制风险的前提下,使基金的长期收益水平高于业绩比较基准。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	021-60637228
传真	(010)58163027	021-60635778
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100738	100033

法定代表人	王珠林	田国立
-------	-----	-----

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	-71,434,418.43
本期利润	-68,057,997.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0616
本期加权平均净值利润率	-2.69%
本期基金份额净值增长率	-2.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	2,040,634,348.84
期末可供分配基金份额利润	1.8599
期末基金资产净值	2,380,045,520.14
期末基金份额净值	2.1692
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	734.46%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.05%	0.79%	1.04%	0.69%	-0.99%	0.10%
过去三个月	-6.48%	0.70%	-3.75%	0.66%	-2.73%	0.04%

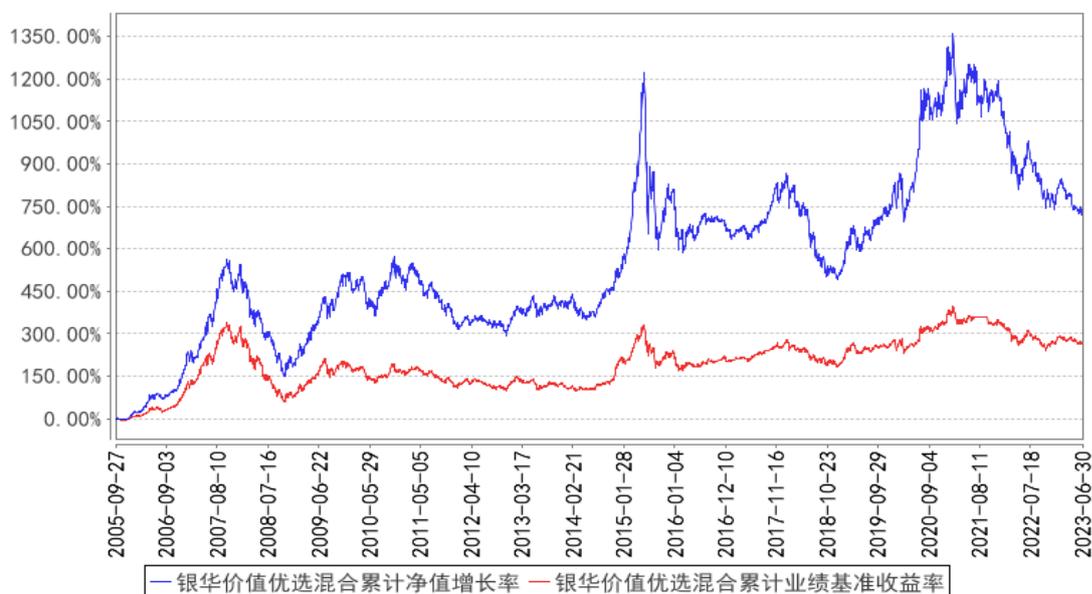
过去六个月	-2.84%	0.76%	-0.03%	0.67%	-2.81%	0.09%
过去一年	-22.82%	0.97%	-10.69%	0.79%	-12.13%	0.18%
过去三年	-22.18%	1.40%	-3.16%	0.96%	-19.02%	0.44%
自基金合同生效起至今	734.46%	1.54%	265.98%	1.31%	468.48%	0.23%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

因为本基金属于混合型基金，一般情况下股票投资比例大约为 80%，因此本基金采用业界较为公认的、市场代表性较好的沪深 300 指数和中国债券总指数加权作为本基金的业绩评价基准。

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

银华价值优选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，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投资比例已达到基金合同的规定：本基金股票投资比例浮动范围：60%-95%；除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为 5%-40%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金投资于股票资产的资金中，不低于 80%的资产将投资于具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊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、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
倪明先生	本基金的基金经理	2011 年 9 月 26 日	-	18 年	博士学位。曾在大成基金管理有限公司从事研究分析工作，历任债券信用分析师、债券基金助理、行业研究员、股票基金助理等职，并曾于 2008 年 1 月 12 日至 2011 年 4 月 15 日期间担任大成创新成长混合型证券投资基金基金经理职务。2011 年 4 月加盟银华基金管理有限公司。自 2011 年 9 月 26 日起担任银华核心价值优选混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 5 月 6 日起兼任银华领先策略混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 8 月 27 日起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基金经理，自 2016 年 7 月 8 日至 2017 年 9 月 4 日兼任银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 8 月 11 日起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 8 日兼任银华估值优势混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 24 日至 2022 年 4 月 8 日兼任银华稳利灵活配置混合型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。具有从业资格。国籍：中国。
苏静然女士	本基金的基金经理	2017年10月30日	-	16.5年	硕士学位。曾就职于工银瑞信基金管理有限公司、宏源证券股份有限公司、诺安基金管理有限公司,先后从事农业、家电、食品饮料行业研究。2014年1月加入银华基金,历任行业研究员、投资经理,基金经理助理。自2017年8月11日起担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10月30日起兼任银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华战略新兴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2017年11月24日至2022年4月8日兼任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2023年1月20日起兼任银华动力领航混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

23 年 1 季度的资本市场出现了整体回暖趋势，万得全 A 本季度+6.5%、上证指数+6%、创业板指+2.3%、科创 50 指数一枝独秀、本季度+12.7%。但 2 季度的资本市场未能延续 1 季度较好的走势，万得全 A 本季度-4.74%、上证指数-3.06%、创业板指-9.42%、科创 50-6.82%，虽然有结构性机会，但波动巨大且市场整体走势较弱

1 季度市场整体复苏，结构性机会突出的核心原因在于以下几点：

1、首先在疫情管控常态后，经济恢复正常运行态势，对于市场的信心和风险偏好都产生了较大的正面影响；

2、其次，今年的政策工作重心重新聚焦于经济发展，市场对于整体的经济产生了乐观预期；

3、以 CHATGPT 为代表的 AI 出现了重大技术创新，提振了整个 AI 及衍生产业链相关的科技股的投资信心；

而进入 2 季度后，市场明显走弱，核心原因在于以下几点：

1、1 季度市场的强劲走势和在疫情管控常态后，对于经济、消费强劲恢复的乐观预期有很大关系，但在指数出现较大反弹后，需要基本面的验证才能继续维持上升走势，可实际的情况是经济处于弱复苏态势，整体情况低于预期。消费和地产销售作为经济的两大支柱，都没有呈现出强劲复苏的态势。

2、其次，在 1 季度市场对于整体的经济以及政策预期都较为乐观，在强调高质量发展的政策大背景下，短期强力的刺激政策并没有在经济处于弱复苏的背景下迅速出台，而是更加着眼于长期，体现出了较好的耐心和定力。

3、以 CHATGPT 为代表的 AI 出现了重大技术创新，提振了整个 AI 及衍生产业链相关的科技股的投资信心，并在 1 季度涨幅巨大，2 季度 AI 依然是整个市场的主线，但波动性明显加大、且主线的范围越来越小，对整体市场未构成较大的提振作用。

在上半年，我们整体的业绩表现处于中游水平，在经济复苏预期逻辑下的工程机械、石油石化、建筑、传媒、电子、计算机等行业中的配置取得了较好的超额收益，但在电新的配置比例较

重且表现不佳，拖累了我们整体的业绩表现。此外对于 AI 和信创我们虽然有所配置，但整体的配置比例不够高，也使得超额收益的积累不够丰厚。具体到行业配置方面，我们重点配置的行业及投资逻辑的情况如下：

1、科技成长方向：

1) 电动车：在 1 季度，我们在电动车产业链的配置比例还是比较高，但整体行业表现很低迷。大的背景还是在于整体电动车的渗透率到了一个较高水平、此外市场在科技成长方面配置最多的就是电新，而在自身行业景气度方面，销售端的低迷以及整车价格战也引发了市场对于整体产业链盈利能力下降的担忧。进入 2 季度后，电动车的边际景气度有所上升，但终端需求依然较弱，考虑到较低的估值和股价位置、以及刺激政策延续对需求的拉动，我们依然看好电动车行业的投资机会。

2) 光伏：光伏基本面强于电动车，但在 1 季度走势也整体偏弱，除了机构配置比例较高外，市场也担心 24 年的增速下行。光伏在 2 季度的表现是强于电动车的，考虑到 2 季度光伏的业绩较好且股价位置依然在相对低位，我们在 2 季度增加了光伏行业的配置比例。

3) 计算机：我们有所配置，并取得了较好的超额收益。信创+AI 两个驱动力都对计算机板块产生了较大的正面刺激作用。但值得我们反思的是这个板块的配置比例相对还是较低，错失了较好的行业超额的机会。

4) 电子：我们在 1 季度是超配电子方向的，在顺周期、半导体国产化方向上都有所配置，并取得了较好的超额收益。进入 2 季度后，我们有所减持，认为超额收益最好的阶段可能就在 1 季度，耐心等待更好的投资时机。

5) 泛 AI 方向：AI 依然是整个上半年市场的主线，我们在相应的方向上有所配置，但一方面是配置的比例不高，另一方面就是集中配置的时间窗口是在 1 季度末，而进入 2 季度后 AI 的波动显著加大，且主线的 CPO 我们配置的比例很低，因此在 AI 方向的配置没有给我们带来明显的超额收益。

6) 军工：军工是我们比较看好的成长股方向，并有所配置，在整个上半年来看，表现还是偏弱。但在 6 月份开始，有逐步走强的迹象。核心原因在于下半年军工企业的业绩确定性会相比上半年显著上升，目前的估值增速匹配度较高，因此我们看好军工的估值修复。

2、大消费方向：

22 年 4 季度疫情管控措施优化后，大消费迎来了一波大幅上涨，进入 23 年，是在持续消化之前的涨幅和估值的，而基本面的复苏力度其实也没有那么强劲，简单来说就是股价走在了基本面前面：

食品饮料：我们在 1 季度平配了白酒板块，超配了啤酒和餐饮供应链板块；考虑到股价表现显著领先于基本面的复苏，因此我们在 2 季度的前半段减持了食品饮料，此后股价下跌幅度很大，估值和股价位置重新回到具有吸引力的位置上，因此在 6 月份我们判断市场处于相对低点时，开始增加食品饮料的配置比例。客观来说，目前基本面和政策预期都没有看到显著变好的迹象，但正因为如此，股价位置是友好的，食品饮料依然是我们长期看好的行业，因此我们选择在左侧增加配置比例。

2) 医药：在 1 季度我们配置了较多的医药行业，看好中药和医美，此外在医疗器械、创新药、原料药和消费医疗等几个方向也有一定的配置比例，主要逻辑是因为景气度在复苏、同时股价已经有较长时间的调整。进入 2 季度后，基于股价涨幅和实际复苏情况弱于预期的考虑，我们有所减持，仅保留了中药的配置比例。

3、价值/地产及产业链方向

地产产业链以及和稳增长相关的顺周期品种（工程机械、基础化工等方向）1 季度先涨后跌，我们在相对高位兑现了工程机械和基础化工相应的持仓。目前处于经济和行业预期都较低的位置，我们看好基于政策乐观预期的左侧布局机会。

我们配置的石油石化、大银行及一带一路方向都取得了较好的超额收益，并在股价的相对高位选择了获利了结。在季度股价出现显著回落后，我们开始关注相关行业的投资机会，相比之前我们对于一带一路相关方向更加看好，并考虑择机布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.1692 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.84%，业绩比较基准收益率为-0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对下半年的资本市场，我们保持谨慎乐观的态度。

科技创新和经济以及消费的复苏会轮流表现，而流动性也会保持在一个相对宽松的状态。在上述分析的基础上，我们进一步落实到行业景气度、公司业绩成长性及估值三个维度，进行组合的结构优化。

如前所述，在下半年我们重点关注并看好的机会包括：新能源、大消费、军工以及跟随政策预期变化的地产及产业链、一带一路政策持续推进下的相关投资机会。

同时，我们也将始终如一的以勤勉尽责的工作态度不断提升自己的专业能力与业务能力，完善优化自己的方法论体系、努力通过深度研究的方式拓展自己的能力圈，力求为持有人持续创造超额收益。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：银华核心价值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	516,780,514.65	220,439,804.45
结算备付金		6,374,127.96	6,184,398.25
存出保证金		1,006,301.06	1,016,852.35
交易性金融资产	6.4.7.2	1,899,707,130.88	2,243,129,060.74
其中：股票投资		1,899,707,130.88	2,243,129,060.74
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		-	27,745,813.92
应收股利		-	-
应收申购款		96,353.01	94,838.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,423,964,427.56	2,498,610,768.48
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		33,725,128.62	805,302.62
应付赎回款		448,965.48	530,578.19

应付管理人报酬		2,934,766.03	3,218,527.95
应付托管费		489,127.70	536,421.35
应付销售服务费		-	-
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	6,320,919.59	4,775,815.11
负债合计		43,918,907.42	9,866,645.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	339,411,171.30	344,844,829.49
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,040,634,348.84	2,143,899,293.77
净资产合计		2,380,045,520.14	2,488,744,123.26
负债和净资产总计		2,423,964,427.56	2,498,610,768.48

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1692 元，基金份额总额 1,097,188,878.40 份。

6.2 利润表

会计主体：银华核心价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-45,995,759.62	-419,646,653.37
1. 利息收入		718,803.30	583,758.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	718,803.30	583,758.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-50,109,379.40	-389,535,058.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-63,777,187.21	-409,123,279.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	13,667,807.81	19,588,221.66
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	3,376,421.00	-30,715,722.11
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	18,395.48	20,368.49
减：二、营业总支出		22,062,237.81	26,631,689.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,798,445.29	22,715,064.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,133,074.21	3,785,844.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	130,718.31	130,780.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-68,057,997.43	-446,278,342.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-68,057,997.43	-446,278,342.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-68,057,997.43	-446,278,342.99

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华核心价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	344,844,829.49	-	2,143,899,293.77	2,488,744,123.26

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）	344,844,829.49	-	2,143,899,293.77	2,488,744,123.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,433,658.19	-	-103,264,944.93	-108,698,603.12
（一）、综合收益总额	-	-	-68,057,997.43	-68,057,997.43
（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）	-5,433,658.19	-	-35,206,947.50	-40,640,605.69
其中：1. 基金申购款	6,163,935.32	-	39,467,851.68	45,631,787.00
2. 基金赎回款	-11,597,593.51	-	-74,674,799.18	-86,272,392.69
（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）	339,411,171.30	-	2,040,634,348.84	2,380,045,520.14
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	350,100,689.27	-	3,276,820,360.65	3,626,921,049.92
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)	350,100,689.27	-	3,276,820,360.65	3,626,921,049.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,089,981.58	-	-471,272,337.29	-474,362,318.87
(一)、综合收益总额	-	-	-446,278,342.99	-446,278,342.99
(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)	-3,089,981.58	-	-24,993,994.30	-28,083,975.88
其中：1. 基金申购款	8,275,116.28	-	64,328,273.74	72,603,390.02
2. 基金赎回款	-11,365,097.86	-	-89,322,268.04	-100,687,365.90
(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)	347,010,707.69	-	2,805,548,023.36	3,152,558,731.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华核心价值优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会

会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]117 号文《关于同意银华核心价值优选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于 2005 年 8 月 1 日至 2005 年 9 月 16 日向社会公开发行募集，基金合同于 2005 年 9 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 519,070,123.63 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为银华基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定，经协商基金托管人同意，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起，本基金名称由“银华核心价值优选股票型证券投资基金”更名为“银华核心价值优选混合型证券投资基金”。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合的基本范围：股票资产（A 股、存托凭证以及监管机构授权的其他市场的股票资产等）、债券资产（国债、金融债、企业债、可转债等债券资产）、货币市场工具（含央行票据、债券回购等）以及现金资产；本基金还可以投资法律、法规允许的其它金融工具。各类资产投资比例须符合《基金法》的规定。本基金的具体投资比例如下：股票投资比例浮动范围：60%-95%；除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为 5%-40%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于股票资产的资金中，不低于 80% 的资产将投资于具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的公司。本基金投资的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

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 2023 年 06 月 30 日的财

务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

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%；

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

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

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	516,780,514.65
等于：本金	516,734,240.29
加：应计利息	46,274.36
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	516,780,514.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,005,495,137.84	-	1,899,707,130.88	-105,788,006.96
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	2,005,495,137.84	-	1,899,707,130.88	-105,788,006.96

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

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	198.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,424,620.95
其中：交易所市场	5,424,620.95
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	216,575.64
其他	679,524.73
合计	6,320,919.59

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,114,753,860.40	344,844,829.49
本期申购	19,925,658.61	6,163,935.32
本期赎回（以“-”号填列）	-37,490,640.61	-11,597,593.51
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,097,188,878.40	339,411,171.30

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,801,689,860.32	-657,790,566.55	2,143,899,293.77
本期利润	-71,434,418.43	3,376,421.00	-68,057,997.43
本期基金份额交易产生的变动数	-44,271,397.26	9,064,449.76	-35,206,947.50
其中：基金申购款	49,985,975.65	-10,518,123.97	39,467,851.68
基金赎回款	-94,257,372.91	19,582,573.73	-74,674,799.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,685,984,044.63	-645,349,695.79	2,040,634,348.84

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	648,434.02
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	62,078.32
其他	8,290.96
合计	718,803.30

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-63,777,187.21
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	-63,777,187.21

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	6,355,224,057.06
减：卖出股票成本总额	6,400,911,662.39
减：交易费用	18,089,581.88
买卖股票差价收入	-63,777,187.21

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,667,807.81
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	13,667,807.81

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	3,376,421.00
股票投资	3,376,421.00
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	3,376,421.00

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	18,395.48
合计	18,395.48

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	52,068.27
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	542.67
账户维护费	18,600.00
合计	130,718.31

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人的股东、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、基金代销机构
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
第一创业	1,212,782,208.36	9.77	-	-
东北证券	776,034,547.24	6.25	188,015,440.13	2.53
西南证券	3,136,592,435.48	25.28	2,560,124,014.53	34.48

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例 (%)
东北证券	722,720.14	6.72	722,720.14	13.32
第一创业	1,129,461.75	10.50	1,129,461.75	20.82
西南证券	2,642,824.65	24.57	81,218.65	1.50
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例 (%)
东北证券	175,097.89	2.78	-	-
西南证券	2,384,222.09	37.91	1,196,433.93	42.07

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	18,798,445.29

其中：支付销售机构的客户维护费	3,298,481.00	3,979,929.86
-----------------	--------------	--------------

注：基金管理费每日计提，按月支付。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：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,133,074.21	3,785,844.10

注：基金托管费每日计提，按月支付。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：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	516,780,514.65	648,434.02	323,371,040.74	523,327.25

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内（含）	新股流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	516,780,514.65	-	-	-	516,780,514.65
结算备付金	6,374,127.96	-	-	-	6,374,127.96
存出保证金	1,006,301.06	-	-	-	1,006,301.06
交易性金融资产	-	-	-	-1,899,707,130.88	1,899,707,130.88
应收申购款	-	-	-	96,353.01	96,353.01
资产总计	524,160,943.67	-	-	-1,899,803,483.89	2,423,964,427.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	448,965.48	448,965.48
应付管理人报酬	-	-	-	2,934,766.03	2,934,766.03
应付托管费	-	-	-	489,127.70	489,127.70
应付清算款	-	-	-	33,725,128.62	33,725,128.62
其他负债	-	-	-	6,320,919.59	6,320,919.59
负债总计	-	-	-	43,918,907.42	43,918,907.42
利率敏感度缺口	524,160,943.67	-	-	-1,855,884,576.47	2,380,045,520.14
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	220,439,804.45	-	-	-	220,439,804.45
结算备付金	6,184,398.25	-	-	-	6,184,398.25
存出保证金	1,016,852.35	-	-	-	1,016,852.35
交易性金融资产	-	-	-	-2,243,129,060.74	2,243,129,060.74
应收申购款	-	-	-	94,838.77	94,838.77
应收清算款	-	-	-	27,745,813.92	27,745,813.92
资产总计	227,641,055.05	-	-	-2,270,969,713.43	2,498,610,768.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	530,578.19	530,578.19
应付管理人报酬	-	-	-	3,218,527.95	3,218,527.95
应付托管费	-	-	-	536,421.35	536,421.35
应付清算款	-	-	-	805,302.62	805,302.62
其他负债	-	-	-	4,775,815.11	4,775,815.11
负债总计	-	-	-	9,866,645.22	9,866,645.22
利率敏感度缺口	227,641,055.05	-	-	-2,261,103,068.21	2,488,744,123.26

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 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,899,707,130.88	79.82	2,243,129,060.74	90.13
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	1,899,707,130.88	79.82	2,243,129,060.74	90.13

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%基金资产净值相应变化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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	120,291,912.06	148,217,912.01
	业绩比较基准下降 5%	-120,291,912.06	-148,217,912.01

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,899,522,246.04	2,242,652,469.76
第二层次	124,755.68	-
第三层次	60,129.16	476,590.98
合计	1,899,707,130.88	2,243,129,060.74

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	1,899,707,130.88	78.37
	其中：股票	1,899,707,130.88	78.37
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	523,154,642.61	21.58
8	其他各项资产	1,102,654.07	0.05
9	合计	2,423,964,427.56	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	11,575,785.00	0.49
B	采矿业	44,385,665.20	1.86
C	制造业	1,493,420,993.68	62.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,125,350.25	1.06
E	建筑业	55,419,523.40	2.33
F	批发和零售业	45,470,955.89	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	66,245,791.82	2.78

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	92,572,511.76	3.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	31,092,154.00	1.31
L	租赁和商务服务业	14,897,454.46	0.63
M	科学研究和技术服务业	12,740.04	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	19,488,205.38	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,899,707,130.88	79.82

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	77,222	130,582,402.00	5.49
2	601816	京沪高铁	12,594,257	66,245,791.82	2.78
3	002594	比亚迪	221,118	57,108,145.86	2.40
4	000858	五粮液	285,700	46,731,949.00	1.96
5	688008	澜起科技	800,853	45,984,979.26	1.93
6	603712	七一二	1,331,589	40,227,303.69	1.69
7	600435	北方导航	3,291,101	37,814,750.49	1.59
8	002128	电投能源	2,610,600	34,512,132.00	1.45
9	002466	天齐锂业	492,300	34,416,693.00	1.45
10	002460	赣锋锂业	554,283	33,789,091.68	1.42
11	600573	惠泉啤酒	2,848,500	33,754,725.00	1.42
12	000568	泸州老窖	160,500	33,635,985.00	1.41
13	000002	万科A	2,217,700	31,092,154.00	1.31
14	600418	江淮汽车	2,303,100	28,996,029.00	1.22
15	600085	同仁堂	493,750	28,420,250.00	1.19
16	603198	迎驾贡酒	419,800	26,783,240.00	1.13
17	300593	新雷能	1,162,720	26,637,915.20	1.12
18	300179	四方达	2,503,300	26,534,980.00	1.11
19	603076	乐惠国际	549,240	26,259,164.40	1.10
20	002906	华阳集团	752,537	25,729,240.03	1.08
21	600872	中炬高新	696,001	25,605,876.79	1.08

22	000875	吉电股份	4,661,475	25,125,350.25	1.06
23	300750	宁德时代	107,380	24,567,470.20	1.03
24	688297	中无人机	477,101	24,470,510.29	1.03
25	600150	中国船舶	736,700	24,244,797.00	1.02
26	688277	天智航	1,314,298	24,235,655.12	1.02
27	300763	锦浪科技	230,000	23,943,000.00	1.01
28	600600	青岛啤酒	227,251	23,550,021.13	0.99
29	002567	唐人神	3,516,900	23,387,385.00	0.98
30	300390	天华新能	652,430	23,356,994.00	0.98
31	603501	韦尔股份	237,610	23,295,284.40	0.98
32	300745	欣锐科技	527,100	23,282,007.00	0.98
33	300693	盛弘股份	628,470	23,203,112.40	0.97
34	688083	中望软件	158,769	23,004,040.41	0.97
35	688022	瀚川智能	635,293	22,953,136.09	0.96
36	300339	润和软件	938,376	22,483,488.96	0.94
37	601668	中国建筑	3,849,560	22,096,474.40	0.93
38	601868	中国能建	9,286,100	21,729,474.00	0.91
39	300474	景嘉微	234,187	21,074,488.13	0.89
40	002493	荣盛石化	1,757,200	20,453,808.00	0.86
41	300896	爱美客	45,517	20,252,789.15	0.85
42	300816	艾可蓝	659,946	19,488,205.38	0.82
43	688106	金宏气体	700,989	19,066,900.80	0.80
44	002028	思源电气	388,900	18,169,408.00	0.76
45	002415	海康威视	547,200	18,117,792.00	0.76
46	300118	东方日升	704,466	18,055,463.58	0.76
47	300418	昆仑万维	423,728	17,067,763.84	0.72
48	002241	歌尔股份	933,500	16,569,625.00	0.70
49	300037	新宙邦	310,600	16,117,034.00	0.68
50	601888	中国中免	134,782	14,897,454.46	0.63
51	002236	大华股份	745,600	14,725,600.00	0.62
52	601799	星宇股份	119,000	14,708,400.00	0.62
53	000977	浪潮信息	295,533	14,333,350.50	0.60
54	688586	江航装备	993,726	13,822,728.66	0.58
55	000821	京山轻机	662,900	13,562,934.00	0.57
56	002007	华兰生物	598,470	13,411,712.70	0.56
57	301015	百洋医药	469,400	13,030,544.00	0.55
58	603081	大丰实业	702,400	12,910,112.00	0.54
59	300415	伊之密	670,400	12,871,680.00	0.54
60	000301	东方盛虹	1,076,363	12,722,610.66	0.53
61	002281	光迅科技	338,763	12,564,719.67	0.53
62	301099	雅创电子	237,376	12,357,794.56	0.52
63	603169	兰石重装	1,650,700	12,281,208.00	0.52
64	688439	振华风光	110,164	12,098,210.48	0.51

65	688793	倍轻松	220,835	11,903,006.50	0.50
66	300454	深信服	104,425	11,826,131.25	0.50
67	603260	合盛硅业	167,600	11,735,352.00	0.49
68	603728	鸣志电器	145,700	11,699,710.00	0.49
69	688339	亿华通	136,604	11,611,340.00	0.49
70	600970	中材国际	909,300	11,593,575.00	0.49
71	603477	巨星农牧	347,100	11,575,785.00	0.49
72	600309	万华化学	130,547	11,467,248.48	0.48
73	600704	物产中大	2,311,600	11,419,304.00	0.48
74	600771	广誉远	321,300	11,332,251.00	0.48
75	603893	瑞芯微	149,500	10,891,075.00	0.46
76	002372	伟星新材	528,707	10,859,641.78	0.46
77	688217	睿昂基因	267,124	10,725,028.60	0.45
78	601579	会稽山	901,800	10,632,222.00	0.45
79	300188	美亚柏科	487,900	10,143,441.00	0.43
80	002155	湖南黄金	809,306	9,873,533.20	0.41
81	301062	上海艾录	909,200	9,628,428.00	0.40
82	300894	火星人	367,100	9,375,734.00	0.39
83	688661	和林微纳	125,392	8,815,057.60	0.37
84	603986	兆易创新	81,794	8,690,612.50	0.37
85	301177	迪阿股份	225,431	8,663,313.33	0.36
86	688560	明冠新材	290,954	8,085,611.66	0.34
87	600556	天下秀	1,135,070	8,047,646.30	0.34
88	688025	杰普特	79,530	6,946,945.50	0.29
89	688800	瑞可达	110,887	6,891,627.05	0.29
90	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.02
91	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
92	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
93	301165	锐捷网络	1,077	66,472.44	0.00
94	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
95	301365	矩阵股份	774	12,740.04	0.00
96	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
97	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
98	301265	华新环保	819	9,516.78	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	300454	深信服	101,568,821.57	4.08
2	002460	赣锋锂业	93,833,876.12	3.77
3	600809	山西汾酒	93,773,065.50	3.77
4	002594	比亚迪	92,814,353.40	3.73

5	000301	东方盛虹	83,295,768.54	3.35
6	603986	兆易创新	76,402,286.00	3.07
7	601816	京沪高铁	71,629,876.91	2.88
8	002812	恩捷股份	70,366,242.91	2.83
9	002241	歌尔股份	67,640,076.56	2.72
10	002466	天齐锂业	65,922,302.60	2.65
11	002101	广东鸿图	64,435,974.98	2.59
12	300339	润和软件	63,340,385.52	2.55
13	688111	金山办公	61,810,165.91	2.48
14	002415	海康威视	61,382,464.00	2.47
15	605117	德业股份	54,929,766.40	2.21
16	688012	中微公司	54,612,939.47	2.19
17	600600	青岛啤酒	54,582,441.00	2.19
18	600745	闻泰科技	54,332,682.04	2.18
19	600938	中国海油	54,147,911.39	2.18
20	000002	万科 A	53,846,660.00	2.16
21	688008	澜起科技	53,429,126.62	2.15
22	300763	锦浪科技	50,931,943.24	2.05
23	601288	农业银行	50,742,587.00	2.04
24	300118	东方日升	50,609,379.00	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。

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	300750	宁德时代	190,266,041.85	7.65
2	002594	比亚迪	116,949,253.80	4.70
3	600031	三一重工	101,649,301.32	4.08
4	002068	黑猫股份	94,905,636.39	3.81
5	600809	山西汾酒	81,858,461.34	3.29
6	002049	紫光国微	80,425,624.77	3.23
7	688041	海光信息	76,201,078.59	3.06
8	300454	深信服	76,198,812.89	3.06
9	688385	复旦微电	75,588,506.71	3.04
10	002812	恩捷股份	74,676,847.80	3.00
11	002460	赣锋锂业	71,535,929.43	2.87
12	600522	中天科技	70,551,658.48	2.83
13	688111	金山办公	69,394,665.60	2.79
14	300782	卓胜微	65,680,970.63	2.64
15	002714	牧原股份	63,136,411.75	2.54
16	688012	中微公司	62,526,470.27	2.51
17	002101	广东鸿图	60,317,035.63	2.42
18	600938	中国海油	60,295,145.90	2.42

19	601288	农业银行	59,981,970.00	2.41
20	600519	贵州茅台	58,337,047.23	2.34
21	000301	东方盛虹	58,275,187.48	2.34
22	688123	聚辰股份	56,979,064.41	2.29
23	601012	隆基绿能	52,205,740.10	2.10
24	300339	润和软件	51,923,793.00	2.09
25	300122	智飞生物	51,770,082.58	2.08
26	600745	闻泰科技	51,483,073.19	2.07
27	300057	万顺新材	50,408,334.09	2.03
28	605117	德业股份	50,148,783.13	2.02
29	603986	兆易创新	49,861,461.38	2.00

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	6,054,113,311.53
卖出股票收入（成交）总额	6,355,224,057.06

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包括赣锋锂业（证券代码：002460）。

根据赣锋锂业 2022 年 7 月 4 日披露的公告，因涉嫌 A 股某上市公司股票二级市场内幕交易，该公司收到中国证监会《立案告知书》。

上述处罚信息公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和析，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	1,006,301.06
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	96,353.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,102,654.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
106,262	10,325.32	3,195,447.96	0.29	1,093,993,430.44	99.71

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	149,555.12	0.01

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005 年 9 月 27 日) 基金份额总额	519,070,123.63
本报告期期初基金份额总额	1,114,753,860.40
本报告期基金总申购份额	19,925,658.61
减：本报告期基金总赎回份额	37,490,640.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,097,188,878.40

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 (%)	
西南证券	4	3,136,592,435.48	25.28	2,642,824.65	24.57	-
长江证券	2	1,504,470,923.45	12.12	1,352,397.19	12.57	-
第一创业	2	1,212,782,208.36	9.77	1,129,461.75	10.5	-
招商证券	2	805,275,091.49	6.49	749,952.66	6.97	-
东北证券	5	776,034,547.24	6.25	722,720.14	6.72	-
银河证券	1	766,875,138.08	6.18	714,192.43	6.64	-
方正证券	4	659,647,344.98	5.32	482,398.87	4.48	-
华泰证券	3	654,047,837.12	5.27	478,303.91	4.45	-

东方证券	3	556,616,407. 24	4.49	407,052.73	3.78	-
长城证券	2	549,787,309. 26	4.43	512,028.06	4.76	-
财通证券	2	487,096,948. 21	3.93	356,214.95	3.31	-
华创证券	2	432,571,103. 87	3.49	402,852.57	3.74	-
广发证券	2	328,578,330. 62	2.65	306,003.41	2.84	-
申万宏源	2	146,727,361. 18	1.18	136,643.60	1.27	-
中金公司	2	108,171,883. 54	0.87	100,740.37	0.94	-
光大证券	2	92,306,613.9 2	0.74	85,964.64	0.8	-
民生证券	2	88,617,516.5 6	0.71	82,529.81	0.77	-
东吴证券	2	65,321,926.3 6	0.53	60,830.33	0.57	-
中泰证券	1	37,096,396.9 5	0.3	34,547.97	0.32	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	3	-	-	-	-	-
华福证券	3	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
华金证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	撤销 1 个 交易 单元
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	新增 2 个 交易 单元
中邮证券	2	-	-	-	-	新增 2 个 交易 单元
兴业证券	3	-	-	-	-	-
中信华南	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易 单元
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)

西南证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-

东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
红塔证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-

新时代证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信华南	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

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	《银华核心价值优选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 1 月 20 日
3	《银华核心价值优选混合型证券投资基金 2022 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 3 月 31 日
5	《银华核心价值优选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 20 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于瑞银证券有限责任公司不再代销旗下部分基金的公告》	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	2023 年 4 月 20 日
7	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 4 月 20 日
8	《银华核心价值优选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 5 日
9	《银华核心价值优选混合型证券投资	本基金管理人网站, 中	2023 年 5 月 5 日

	基金招募说明书更新(2023 年第 1 号)》	国证监会基金电子披露网站	
--	-------------------------	--------------	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会核准银华核心价值优选股票型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华核心价值优选混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华核心价值优选混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华核心价值优选混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

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

2023 年 8 月 29 日