

# 银华增强收益债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
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	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.11 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华增强收益债券型证券投资基金
基金简称	银华增强收益债券
基金主代码	180015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 12 月 3 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	196,510,610.90 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险、维护本金相对安全、追求基金资产稳定增值的基础上，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场资金供求状况等因素的基础上，自上而下确定大类金融资产配置和固定收益类金融工具的类型配置，动态调整组合久期，并通过自下而上精选个券，构建和调整固定收益投资组合，获取稳健收益；此外，本基金还将在严格控制风险的前提下积极参加股票一级市场申购，适度参与股票二级市场和权证投资，力争提高投资组合收益率水平。</p> <p>本基金对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，持有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%。本基金还可投资于股票、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。</p>
业绩比较基准	中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	银华基金管理股份有限公司	中国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	张金良
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-8,607,895.41
本期利润	399,787.75
加权平均基金份额本期利润	0.0014
本期加权平均净值利润率	0.13%
本期基金份额净值增长率	0.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-9,341,021.25
期末可供分配基金份额利润	-0.0475
期末基金资产净值	225,933,451.48
期末基金份额净值	1.150
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	111.61%

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

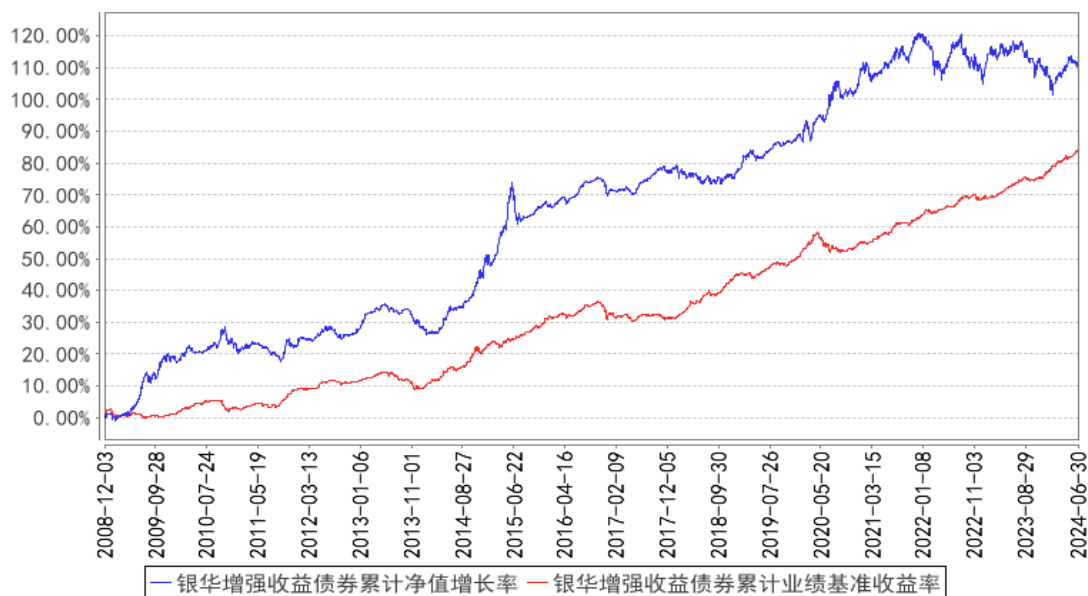
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	-0.26%	0.22%	0.94%	0.04%	-1.20%	0.18%
过去三个月	1.59%	0.24%	1.75%	0.09%	-0.16%	0.15%
过去六个月	0.70%	0.31%	3.83%	0.09%	-3.13%	0.22%
过去一年	-2.21%	0.30%	5.99%	0.08%	-8.20%	0.22%
过去三年	-0.17%	0.32%	16.31%	0.08%	-16.48%	0.24%
自基金合同生效起至今	111.61%	0.27%	84.04%	0.11%	27.57%	0.16%

### 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

银华增强收益债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，持有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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资于股票、存托凭证、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。

## § 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人管理 214 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金（LOF）、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）、银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金（LOF）、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合



型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金 (QDII)、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、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、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金（LOF）、银华华智三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放

式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金、银华顺和债券型证券投资基金、银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华医疗健康混合型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华月月享 30 天持有期债券型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华惠享三年定期开放混合型证券投资基金、银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金、银华致淳债券型证券投资基金、银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华新材料混合型发起式证券投资基金、银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、银华晶鑫债券型证券投资基金、银华安泰债券型证券投资基金、银华中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金、银华中证 0-5 年政策性金融债指数证券投资基金、银华盛泓债券型证券投资基金、银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金、银华钰祥债券型证券投资基金、银华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金、银华季季鑫 90 天持有期债券型证券投资基金、银华富兴央企 6 个月封闭运作混合型发起式证券投资基金、银华月月鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、银华恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金、银华嘉选平衡混合型发起式证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾鹏先生	本基金的基金经理	2020 年 2 月 19 日	-	15.5 年	硕士学位，2008 年 3 月至 2011 年 3 月期间任职于银华基金管理有限公司，担任行业研究员职务；2011 年 4 月至 2012 年 3 月期间任职于瑞银证券有限责任公司，担任行业研究组长；2012 年 4 月至 2014 年 6 月期间任职于建信基金管理有限公司，

					担任基金经理助理。2014 年 6 月起任职于银华基金管理有限公司，自 2014 年 8 月 27 日至 2017 年 8 月 7 日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理，自 2014 年 8 月 27 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金经理，自 2014 年 9 月 12 日至 2020 年 3 月 16 日兼任银华保本增值证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 17 日至 2020 年 5 月 21 日兼任银华增值证券投资基金基金经理，自 2014 年 12 月 31 日至 2016 年 12 月 22 日兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 1 日至 2017 年 7 月 5 日兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2016 年 5 月 19 日起兼任银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 8 月 8 日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 14 日起兼任银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 1 月 29 日至 2021 年 7 月 30 日兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自 2019 年 6 月 28 日起兼任银华信用双利债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 6 日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 2 月 19 日起兼任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 10 日起兼任银华多元机遇混合型证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 8 日起兼任银华远兴一年持有期债券型证券投资基金基金经理，自 2021 年 7 月 15 日起兼任银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
冯帆女士	本基金的基金经理	2020 年 12 月 29 日	-	10 年	硕士学位。曾就职于华夏未来资本管理有限公司，2015 年 8 月加入银华基金，历任投资管理三部宏观利率研究员、基金经理助理，现任养老金投资管理部基金经理。自 2020 年 12 月 29 日起担任银华增强收益债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
魏晟峻先	本基金的基金经理	2019 年 11 月 15 日	-	10.5 年	硕士学位，曾就职于信达创新有限公司，2016 年 5 月加入银华基金，历任投资管

生	助理	日			理三部固收交易部询价交易员, 现任固定收益及资产配置部基金经理助理。具有从业资格。国籍: 中国。
张雨先生	本基金的基金经理助理	2023 年 7 月 14 日	-	3.5 年	博士学位。2020 年 7 月加入银华基金管理股份有限公司, 现任养老金投资管理部基金经理助理。具有从业资格。国籍: 中国。

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华增强收益债券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

回顾 2024 年上半年, 经济基本面边际有所放缓, 但总体仍保持在政策合意区间。结构上, 供需裂口较前期有所收敛, 且存在出口链条、设备更新改造等亮点。货币流动性方面, 总体呈现资

金面平稳适中、央行流动性投放均衡的特征。权益市场在上半年围绕政策预期与经济现实展开博弈，跌宕起伏，整体收平。分行业看，市场保持分化格局：红利风格占优，大金融、家电、公用事业、煤炭等超额收益明显，科技方向也有主题反弹，消费和地产方向则相对偏弱。债券市场在上半年延续上涨行情，基本面磨底下机构普遍存在配置压力。不过，随着收益率快速下行至低位，债券市场波动性有所放大。转债市场总体跟随权益节奏，不过受到严监管下小微市值退市风险以及弱资质转债评级下调的影响，几度出现品种层面的明显调整。

操作上，我们总体保持了均衡的配置。股票方面，根据市场情况进行了一些结构调整。考虑到消费整体的修复力度仍然较弱，我们适当降低了消费和医药的持仓，增加了低估值红利资产的配置。在科技领域聚焦制造方向，子行业选择相对比较均衡。总体上，我们持续降低了小市值因子的暴露度，并在二季度边际加强了电子的配置，降低了海外链敞口。债券方面，结合整体组合的风险收益特征，保持一定久期下，结构上积极进行了利差轮动操作，充分挖掘曲线结构上的定价机会。在转债的投资上，操作重点在于以精选结构的优势来对抗资产整体负凸性的劣势，并在比价优势明显时进行大类资产间的阶段性切换。

#### 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 1.150 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.70%，业绩比较基准收益率为 3.83%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们将继续在把握投资组合风险收益特征的前提下，积极寻找机会。基本面层面，地产政策的调整与发力，财政发债与开工节奏的加快，均有利于宏观预期的边际改善；流动性层面，美国通胀与降息交易在波折中推进，短期内再度处于通胀降温与流动性改善窗口，同时国内在呵护经济的诉求下，总量宽松政策也有望逐步落地。当然，对于权益资产而言，高度与持续性最终仍然需要看到政策到盈利端的兑现。在此之前，交易节奏以及其他风险因子的扰动仍然不可避免。对于纯债资产，机构欠配的现实压力下，市场倾向于更多交易现实而非预期。不过，接下来低利率、低利差、高波动也将逐步成为市场新格局。操作上回归中性，以利差轮动与骑乘策略为主。转债继续保持适度积极的操作，核心是机会成本角度进行多资产比价。不过在这个过程中，择券依然重要，转债组合需持续保持在风险收益比占优的凸性状态。

具体到权益资产方面，市场重回低位后，我们对中期机会保持乐观，当前时点耐心更加重要。向后展望，7 月国内有重要会议召开，届时政策脉络进一步明朗，有利于风险偏好的提升。结构上看，考虑到 7-8 月市场逐渐迎来业绩披露期，处于行业周期拐点或者业绩景气确定性高的板块有望出现行情催化。

科技方向：上半年 A 股市场总体处于少部分方向的右侧加强趋势中，主线在红利和外需两块。科技方向总基调先抑后扬，并在业绩带动下逐步聚焦到 AI 主线。另一部分行业则在上半年持续寻底，比如新能源、军工、电动车链条。下半年，分母端的制约因素有望边际缓和，分子端的影响可能出现更多积极信号。业绩稳健的红利和业绩边际改善概率高的科技是当前的两大抓手，而消费和地产尽管位置和拥挤度都低，但催化节奏需要观察。横向比较科技制造大板块的不同方向，我们重点关注以下几个方面：（1）首要关注业绩好的方向，对应海外算力、电子。（2）其次适当关注科技内部的困境反转方向，以景气度触底和股价位置偏低为主要标准，我们判断军工行业、及设备更新改造方向（比如电力设备、工程机械、核电等）、汽车锂电行业、储能都可能存在上行修复催化，中报落地前后，行业贝塔可能逐步由弱转强，但考虑到困境反转不太会一蹴而就，初期选股更为重要。

消费方向：短期看收入预期走弱仍是压制居民消费力的主要因素，当前的股价也基本反应了较差的基本面。中期看，结构变化仍是我们持续关注的重点，寻找更高质价比已经成为最重要的趋势，一些具有强供应链能力和产品开发能力的公司有望通过份额提升开启新一轮的成长，关注出口制造、黄金珠宝、啤酒、餐饮、两轮车等细分领域龙头。另外生猪养殖板块经过连续的产能去化后，当前已经进入基本面右侧阶段，未来随着猪价上涨，板块有望获得超额收益。对于医药，板块上半年表现低于预期。认为行业当下处于底部区域：一方面，下半年随着基数的回落，政策对基本面的影响会边际减弱，同比数据有望逐步修复。另一方面，医药行业的成长性依然很好，老龄化带来需求高景气度，同时创新出海也开辟了新的市场空间，这都给行业带来更多机会。因此我们仍然维持一定的配置比例。

低估值方向：从中长期角度看，宏观经济仍旧在转型阶段，当前低利率环境大概率还要延续，在“安全”和“防御”为主的投资风格影响下，红利策略仍然具备长期的配置价值。如有回调可关注银行、交运、石油石化等。

#### 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的真实、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：银华增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			



货币资金	6.4.7.1	1,768,958.15	1,502,704.05
结算备付金		7,673,278.31	2,191,253.82
存出保证金		33,952.37	38,900.93
交易性金融资产	6.4.7.2	304,846,998.31	559,701,562.21
其中：股票投资		35,460,859.13	78,515,177.13
基金投资		-	-
债券投资		269,386,139.18	481,186,385.08
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	-	13,999,863.85
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		338,562.88	13,605,094.08
应收股利		-	-
应收申购款		915.42	3,588.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		314,662,665.44	591,042,967.56
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		84,912,450.85	144,047,607.04
应付清算款		600,901.75	13,456,679.08
应付赎回款		785.44	388,547.92
应付管理人报酬		126,314.33	235,649.79
应付托管费		38,865.93	72,507.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,798,058.10	2,817,627.55
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	251,837.56	290,585.51
负债合计		88,729,213.96	161,309,204.49
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.10	196,510,610.90	376,271,293.23
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	29,422,840.58	53,462,469.84
净资产合计		225,933,451.48	429,733,763.07
负债和净资产总计		314,662,665.44	591,042,967.56

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.150 元，基金份额总额 196,510,610.90 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		3,071,706.56	12,297,901.04
1. 利息收入		80,184.13	63,234.23
其中：存款利息收入	6.4.7.13	49,238.58	32,514.51
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		30,945.55	30,719.72
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,053,756.55	7,602,038.71
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,042,289.11	-17,476.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,447,257.93	7,095,799.48
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	541,274.63	523,715.93
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	9,007,683.16	4,614,642.35
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.21	37,595.82	17,985.75

号填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		2,671,918.81	2,190,877.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,040,223.84	875,154.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	320,068.86	269,278.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,192,200.04	929,433.04
其中：卖出回购金融资产支出		1,192,200.04	929,433.04
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		9,130.69	8,846.26
8. 其他费用	6.4.7.23	110,295.38	108,165.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		399,787.75	10,107,024.02
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		399,787.75	10,107,024.02
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		399,787.75	10,107,024.02

### 6.3 净资产变动表

会计主体：银华增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	376,271,293.23	-	53,462,469.84	429,733,763.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	376,271,293.23	-	53,462,469.84	429,733,763.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-179,760,682.3 3	-	-24,039,629.26	-203,800,311.59
(一)、综合收益总额	-	-	399,787.75	399,787.75

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-179,760,682.33		-24,439,417.01	-204,200,099.34
其中: 1. 基金申购款	635,034.31		93,231.10	728,265.41
2. 基金赎回款	-180,395,716.64		-24,532,648.11	-204,928,364.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-		-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-		-	-
四、本期期末净资产	196,510,610.90		29,422,840.58	225,933,451.48
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	203,237,642.19	-	25,793,060.13	229,030,702.32
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	203,237,642.19	-	25,793,060.13	229,030,702.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	126,851,867.09	-	32,161,739.10	159,013,606.19
(一)、综合收益总额	-	-	10,107,024.02	10,107,024.02
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	126,851,867.09	-	22,054,715.08	148,906,582.17

其中：1. 基金申购款	239,824,227.40	-	41,182,447.27	281,006,674.67
2. 基金赎回款	-112,972,360.31	-	-19,127,732.19	-132,100,092.50
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	330,089,509.28	-	57,954,799.23	388,044,308.51

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

银华增强收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]1157 号文《关于核准银华增强收益债券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 2008 年 10 月 30 日至 2008 年 11 月 28 日向社会公开募集，基金合同于 2008 年 12 月 3 日生效。首次设立募集规模为 2,466,876,891.58 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和注册登记机构为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、存托凭证、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于国债、金融债券、企业债券、公司债券、中央银行票据、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、短期融资券、资产支持证券等固定收益类金融工具。本基金对债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的 80%，持有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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资于股票、

存托凭证、权证等权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第

39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

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

货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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

#### 6.4.6.3 企业所得税

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

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

#### 6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	1,768,958.15
等于：本金	1,768,768.35
加：应计利息	189.80
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	1,768,958.15

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	35,289,621.21	-	35,460,859.13	171,237.92	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	140,180,148.85	1,399,926.01	142,992,620.71	1,412,545.85
	银行间市场	123,392,252.40	1,634,518.47	126,393,518.47	1,366,747.60
	合计	263,572,401.25	3,034,444.48	269,386,139.18	2,779,293.45
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	298,862,022.46	3,034,444.48	304,846,998.31	2,950,531.37	

#### 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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.14
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	107,006.10
其中：交易所市场	97,510.60
银行间市场	9,495.50
应付利息	-
预提费用	134,535.36
其他	10,295.96

合计	251,837.56
----	------------

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	376,271,293.23	376,271,293.23
本期申购	635,034.31	635,034.31
本期赎回（以“-”号填列）	-180,395,716.64	-180,395,716.64
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	196,510,610.90	196,510,610.90

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	-12,041,113.25	65,503,583.09	53,462,469.84
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-12,041,113.25	65,503,583.09	53,462,469.84
本期利润	-8,607,895.41	9,007,683.16	399,787.75
本期基金份额交易产生的变动数	11,307,987.41	-35,747,404.42	-24,439,417.01
其中：基金申购款	-38,502.96	131,734.06	93,231.10
基金赎回款	11,346,490.37	-35,879,138.48	-24,532,648.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,341,021.25	38,763,861.83	29,422,840.58

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	11,794.23
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	37,173.38
其他	270.97
合计	49,238.58

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,042,289.11
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	-10,042,289.11

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	127,769,430.91
减：卖出股票成本总额	137,540,576.90
减：交易费用	271,143.12
买卖股票差价收入	-10,042,289.11

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,482,518.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,035,260.41
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	3,447,257.93
----	--------------

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	786,130,600.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	778,966,999.30
减：应计利息总额	8,168,913.38
减：交易费用	29,948.15
买卖债券差价收入	-1,035,260.41

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	541,274.63
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	541,274.63

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	9,007,683.16
股票投资	7,197,483.16
债券投资	1,810,200.00
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	9,007,683.16

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	27,866.74
基金转换费收入	9,729.08
合计	37,595.82

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：无。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	7,160.02
账户维护费	18,600.00
合计	110,295.38

**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
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（“银华基金”）	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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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	72,126,576.56	33.54	46,457,540.81	21.19
东北证券	5,129,033.50	2.38	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
第一创业	325,216,213.59	45.18	194,730,984.70	29.80
东北证券	19,925,354.13	2.77	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
第一创业	1,814,444,000.00	31.00	754,389,000.00	37.45
东北证券	63,710,000.00	1.09	-	-

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东北证券	4,851.50	2.51	-	-
第一创业	68,225.51	35.27	5,612.14	5.76
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			



	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
第一创业	43,265.53	22.75	9,030.13	9.11

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,040,223.84	875,154.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	71,998.98	59,770.50
应支付基金管理人的净管理费	968,224.86	815,383.59

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 0.65% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.65\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	320,068.86	269,278.20

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,768,958.15	11,794.23	2,977,675.15	13,461.67

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（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 20,009,450.85 元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (张)	期末估值总额
102001193	20 汉江国资 MTN001	2024 年 7 月 2 日	101.92	100,000	10,192,243.29
102381750	23 中交建 MTN001	2024 年 7 月 2 日	103.74	12,000	1,244,842.10
102381750	23 中交建 MTN001	2024 年 7 月 5 日	103.74	88,000	9,128,842.05
232480008	24 中行二级资本债 02A	2024 年 7 月 5 日	102.39	18,000	1,843,062.61
合计				218,000	22,408,990.05

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 64,903,000.00 元, 于 2024 年 07 月 01 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注: 无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,768,958.15	-	-	-	1,768,958.15
结算备付金	7,673,278.31	-	-	-	7,673,278.31
存出保证金	33,952.37	-	-	-	33,952.37
交易性金融资产	100,667,135.61	93,497,734.66	75,221,268.91	35,460,859.13	304,846,998.31
应收申购款	-	-	-	915.42	915.42
应收清算款	-	-	-	338,562.88	338,562.88
资产总计	110,143,324.44	93,497,734.66	75,221,268.91	35,800,337.43	314,662,665.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	785.44	785.44
应付管理人报酬	-	-	-	126,314.33	126,314.33
应付托管费	-	-	-	38,865.93	38,865.93
应付清算款	-	-	-	600,901.75	600,901.75
卖出回购金融资产款	84,912,450.85	-	-	-	84,912,450.85
应交税费	-	-	-	2,798,058.10	2,798,058.10
其他负债	-	-	-	251,837.56	251,837.56
负债总计	84,912,450.85	-	-	3,816,763.11	88,729,213.96
利率敏感度缺口	25,230,873.59	93,497,734.66	75,221,268.91	31,983,574.32	225,933,451.48
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,502,704.05	-	-	-	1,502,704.05
结算备付金	2,191,253.82	-	-	-	2,191,253.82
存出保证金	38,900.93	-	-	-	38,900.93
交易性金融资产	167,066,546.17	308,416,372.42	5,703,466.49	78,515,177.13	559,701,562.21
买入返售金融资产	13,999,863.85	-	-	-	13,999,863.85
应收申购款	-	-	-	3,588.62	3,588.62
应收清算款	-	-	-	13,605,094.08	13,605,094.08
资产总计	184,799,268.82	308,416,372.42	5,703,466.49	92,123,859.83	591,042,967.56

负债					
应付赎回款	-	-	-	388,547.92	388,547.92
应付管理人报酬	-	-	-	235,649.79	235,649.79
应付托管费	-	-	-	72,507.60	72,507.60
应付清算款	-	-	-	13,456,679.08	13,456,679.08
卖出回购金融资产款	144,047,607.04	-	-	-	144,047,607.04
应交税费	-	-	-	2,817,627.55	2,817,627.55
其他负债	-	-	-	290,585.51	290,585.51
负债总计	144,047,607.04	-	-	17,261,597.45	161,309,204.49
利率敏感度缺口	40,751,661.78	308,416,372.42	5,703,466.49	74,862,262.38	429,733,763.07

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-2,420,178.21	-2,098,350.14
	-25 个基点	2,420,178.21	2,098,350.14

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	35,460,859.13	15.70	78,515,177.13	18.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	269,386,139.18	119.23	481,186,385.08	111.97
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	304,846,998.31	134.93	559,701,562.21	130.24

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	-6,570,404.61	-19,381,741.59
	业绩比较基准下降 5%	6,570,404.61	19,381,741.59

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	94,272,206.59	181,353,679.37
第二层次	210,574,791.72	378,347,882.84
第三层次	-	-
合计	304,846,998.31	559,701,562.21

##### 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	35,460,859.13	11.27
	其中：股票	35,460,859.13	11.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	269,386,139.18	85.61
	其中：债券	269,386,139.18	85.61
	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	9,442,236.46	3.00
8	其他各项资产	373,430.67	0.12
9	合计	314,662,665.44	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	-	-
B	采矿业	3,503,855.00	1.55
C	制造业	18,133,063.71	8.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,389,584.00	1.06
E	建筑业	412,705.00	0.18
F	批发和零售业	76,052.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,319,974.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,099,263.92	0.49
J	金融业	4,718,321.50	2.09
K	房地产业	1,014,132.00	0.45
L	租赁和商务服务业	175,122.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	101,905.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	259,909.00	0.12
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	1,256,972.00	0.56
S	综合	-	-
	合计	35,460,859.13	15.70

### 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	600373	中文传媒	71,300	1,058,092.00	0.47
2	600036	招商银行	28,300	967,577.00	0.43
3	600938	中国海油	28,200	930,600.00	0.41
4	600900	长江电力	31,600	913,872.00	0.40
5	601899	紫金矿业	45,400	797,678.00	0.35
6	600487	亨通光电	44,832	707,000.64	0.31
7	600012	皖通高速	48,000	670,560.00	0.30
8	601658	邮储银行	123,800	627,666.00	0.28
9	300750	宁德时代	3,340	601,300.20	0.27
10	300677	英科医疗	22,200	595,182.00	0.26
11	600519	贵州茅台	400	586,956.00	0.26
12	600150	中国船舶	13,500	549,585.00	0.24
13	001965	招商公路	45,900	544,374.00	0.24
14	600048	保利发展	61,500	538,740.00	0.24
15	600600	青岛啤酒	7,200	523,944.00	0.23
16	000792	盐湖股份	29,800	520,010.00	0.23
17	600426	华鲁恒升	19,500	519,480.00	0.23
18	600011	华能国际	52,500	505,050.00	0.22
19	601816	京沪高铁	92,000	494,040.00	0.22
20	000333	美的集团	7,400	477,300.00	0.21
21	002353	杰瑞股份	12,500	438,500.00	0.19
22	002073	软控股份	58,600	433,054.00	0.19
23	605090	九丰能源	14,900	432,100.00	0.19
24	601857	中国石油	40,700	420,024.00	0.19
25	601818	光大银行	123,700	392,129.00	0.17
26	601138	工业富联	14,100	386,340.00	0.17
27	601288	农业银行	87,100	379,756.00	0.17
28	600765	中航重机	18,600	379,440.00	0.17
29	600583	海油工程	61,200	361,692.00	0.16
30	601668	中国建筑	67,700	359,487.00	0.16
31	601088	中国神华	8,100	359,397.00	0.16
32	688111	金山办公	1,506	342,615.00	0.15
33	301367	怡和嘉业	5,460	339,612.00	0.15
34	002384	东山精密	16,000	331,200.00	0.15
35	002371	北方华创	1,000	319,890.00	0.14
36	002043	兔宝宝	30,400	315,248.00	0.14

37	300394	天孚通信	3,520	311,238.40	0.14
38	601318	中国平安	7,300	301,928.00	0.13
39	601336	新华保险	9,700	291,291.00	0.13
40	601058	赛轮轮胎	20,600	288,400.00	0.13
41	600582	天地科技	41,000	282,490.00	0.13
42	600941	中国移动	2,600	279,500.00	0.12
43	601009	南京银行	26,500	275,335.00	0.12
44	002594	比亚迪	1,100	275,275.00	0.12
45	600325	华发股份	42,300	274,950.00	0.12
46	300274	阳光电源	4,340	269,210.20	0.12
47	600872	中炬高新	11,800	267,742.00	0.12
48	601077	渝农商行	53,300	267,566.00	0.12
49	002756	永兴材料	7,000	250,460.00	0.11
50	002241	歌尔股份	11,900	232,169.00	0.10
51	600809	山西汾酒	1,100	231,968.00	0.10
52	603871	嘉友国际	12,700	224,663.00	0.10
53	688772	珠海冠宇	13,518	201,418.20	0.09
54	601900	南方传媒	16,000	198,880.00	0.09
55	002738	中矿资源	7,300	195,640.00	0.09
56	600529	山东药玻	7,600	192,584.00	0.09
57	601156	东航物流	8,700	177,045.00	0.08
58	000975	山金国际	10,800	175,932.00	0.08
59	605117	德业股份	2,240	166,521.60	0.07
60	600483	福能股份	14,100	164,406.00	0.07
61	601100	恒立液压	3,400	158,372.00	0.07
62	002475	立讯精密	4,000	157,240.00	0.07
63	600660	福耀玻璃	3,200	153,280.00	0.07
64	600760	中航沈飞	3,600	144,360.00	0.06
65	600741	华域汽车	8,700	142,506.00	0.06
66	600989	宝丰能源	8,100	140,373.00	0.06
67	601398	工商银行	23,400	133,380.00	0.06
68	600901	江苏金租	26,400	133,320.00	0.06
69	000888	峨眉山 A	12,100	131,769.00	0.06
70	600066	宇通客车	5,100	131,580.00	0.06
71	600085	同仁堂	3,400	129,914.00	0.06
72	603199	九华旅游	4,300	128,140.00	0.06
73	601231	环旭电子	7,600	121,980.00	0.05
74	600309	万华化学	1,500	121,290.00	0.05
75	002050	三花智控	6,200	118,296.00	0.05
76	000651	格力电器	3,000	117,660.00	0.05
77	601988	中国银行	25,300	116,886.00	0.05
78	000100	TCL 科技	27,000	116,640.00	0.05
79	601728	中国电信	18,800	115,620.00	0.05

80	600398	海澜之家	12,500	115,500.00	0.05
81	600027	华电国际	16,600	115,204.00	0.05
82	002244	滨江集团	15,800	114,708.00	0.05
83	601319	中国人保	21,900	112,785.00	0.05
84	601699	潞安环能	6,200	112,406.00	0.05
85	000625	长安汽车	8,100	108,783.00	0.05
86	002415	海康威视	3,500	108,185.00	0.05
87	002142	宁波银行	4,900	108,094.00	0.05
88	600764	中国海防	5,500	107,965.00	0.05
89	688008	澜起科技	1,842	105,288.72	0.05
90	600587	新华医疗	6,630	104,356.20	0.05
91	600522	中天科技	6,420	101,757.00	0.05
92	688041	海光信息	1,446	101,682.72	0.05
93	600019	宝钢股份	14,100	93,765.00	0.04
94	002532	天山铝业	11,400	92,454.00	0.04
95	600803	新奥股份	4,400	91,520.00	0.04
96	600161	天坛生物	3,720	90,768.00	0.04
97	603893	瑞芯微	1,500	88,755.00	0.04
98	600348	华阳股份	8,900	88,644.00	0.04
99	601601	中国太保	3,100	86,366.00	0.04
100	002939	长城证券	12,700	85,090.00	0.04
101	000425	徐工机械	11,800	84,370.00	0.04
102	603056	德邦股份	6,400	83,840.00	0.04
103	688568	中科星图	1,736	82,807.20	0.04
104	300124	汇川技术	1,614	82,798.20	0.04
105	601717	郑煤机	5,500	81,400.00	0.04
106	600096	云天化	4,000	77,680.00	0.03
107	002906	华阳集团	2,900	77,604.00	0.03
108	603018	华设集团	8,500	77,265.00	0.03
109	300181	佐力药业	5,100	77,112.00	0.03
110	002027	分众传媒	12,700	76,962.00	0.03
111	601666	平煤股份	6,700	75,040.00	0.03
112	600415	小商品城	10,100	74,942.00	0.03
113	688099	晶晨股份	1,086	64,421.52	0.03
114	688208	道通科技	2,668	64,405.52	0.03
115	600329	达仁堂	1,900	61,541.00	0.03
116	600420	国药现代	5,700	60,876.00	0.03
117	600266	城建发展	16,200	60,588.00	0.03
118	002139	拓邦股份	5,700	60,534.00	0.03
119	002993	奥海科技	1,600	59,520.00	0.03
120	600926	杭州银行	4,500	58,725.00	0.03
121	300373	扬杰科技	1,500	58,350.00	0.03
122	002179	中航光电	1,500	57,075.00	0.03

123	601665	齐鲁银行	11,600	56,956.00	0.03
124	603693	江苏新能	4,900	56,938.00	0.03
125	002807	江阴银行	15,000	56,550.00	0.03
126	300772	运达股份	5,800	55,680.00	0.02
127	300408	三环集团	1,900	55,461.00	0.02
128	688050	爱博医疗	754	55,283.28	0.02
129	600787	中储股份	11,300	54,353.00	0.02
130	600845	宝信软件	1,700	54,281.00	0.02
131	002948	青岛银行	15,800	53,246.00	0.02
132	002019	亿帆医药	4,300	53,148.00	0.02
133	000063	中兴通讯	1,900	53,143.00	0.02
134	601633	长城汽车	2,100	53,130.00	0.02
135	601615	明阳智能	5,500	51,920.00	0.02
136	002311	海大集团	1,100	51,755.00	0.02
137	600315	上海家化	2,800	49,784.00	0.02
138	000581	威孚高科	3,000	48,840.00	0.02
139	300910	瑞丰新材	1,100	48,092.00	0.02
140	601919	中远海控	3,100	48,019.00	0.02
141	601636	旗滨集团	7,400	47,730.00	0.02
142	603125	常青科技	2,755	47,413.55	0.02
143	603317	天味食品	4,100	46,781.00	0.02
144	002901	大博医疗	1,800	46,494.00	0.02
145	300146	汤臣倍健	3,400	46,070.00	0.02
146	002922	伊戈尔	2,100	45,906.00	0.02
147	300558	贝达药业	1,400	45,570.00	0.02
148	603899	晨光股份	1,400	43,792.00	0.02
149	300919	中伟股份	1,400	43,386.00	0.02
150	688281	华秦科技	504	41,993.28	0.02
151	603501	韦尔股份	400	39,748.00	0.02
152	603444	吉比特	200	35,602.00	0.02
153	001301	尚太科技	800	34,576.00	0.02
154	688065	凯赛生物	735	33,361.65	0.01
155	300360	炬华科技	1,900	32,300.00	0.01
156	002304	洋河股份	400	32,296.00	0.01
157	300014	亿纬锂能	800	31,936.00	0.01
158	002267	陕天然气	4,100	30,996.00	0.01
159	002635	安洁科技	2,000	30,880.00	0.01
160	002850	科达利	400	30,552.00	0.01
161	601233	桐昆股份	1,900	30,324.00	0.01
162	688559	海目星	917	30,160.13	0.01
163	605368	蓝天燃气	2,200	30,008.00	0.01
164	603360	百傲化学	2,520	29,610.00	0.01
165	600039	四川路桥	3,700	29,193.00	0.01

166	601128	常熟银行	3,850	29,144.50	0.01
167	300760	迈瑞医疗	100	29,091.00	0.01
168	603328	依顿电子	3,700	29,082.00	0.01
169	600000	浦发银行	3,500	28,805.00	0.01
170	300457	赢合科技	1,600	28,528.00	0.01
171	601933	永辉超市	11,500	28,520.00	0.01
172	601225	陕西煤业	1,100	28,347.00	0.01
173	605507	国邦医药	1,700	28,305.00	0.01
174	603203	快克智能	1,200	28,296.00	0.01
175	300170	汉得信息	4,600	28,244.00	0.01
176	601166	兴业银行	1,600	28,192.00	0.01
177	600546	山煤国际	1,900	27,778.00	0.01
178	002185	华天科技	3,400	27,710.00	0.01
179	300776	帝尔激光	600	27,576.00	0.01
180	002138	顺络电子	1,000	27,460.00	0.01
181	002487	大金重工	1,200	27,456.00	0.01
182	300638	广和通	1,600	27,360.00	0.01
183	601838	成都银行	1,800	27,342.00	0.01
184	300207	欣旺达	1,800	27,306.00	0.01
185	300031	宝通科技	1,900	27,303.00	0.01
186	301004	嘉益股份	300	27,300.00	0.01
187	300054	鼎龙股份	1,200	27,216.00	0.01
188	300470	中密控股	800	27,048.00	0.01
189	600395	盘江股份	4,500	27,045.00	0.01
190	688408	中信博	292	26,887.36	0.01
191	300482	万孚生物	1,100	26,840.00	0.01
192	002020	京新药业	2,500	26,175.00	0.01
193	601990	南京证券	3,400	26,112.00	0.01
194	603515	欧普照明	1,500	26,010.00	0.01
195	002601	龙佰集团	1,400	25,998.00	0.01
196	003021	兆威机电	560	25,844.00	0.01
197	601997	贵阳银行	4,900	25,823.00	0.01
198	300628	亿联网络	700	25,739.00	0.01
199	002318	久立特材	1,100	25,663.00	0.01
200	002340	格林美	4,000	25,480.00	0.01
201	688520	神州细胞	642	25,262.70	0.01
202	600919	江苏银行	3,400	25,262.00	0.01
203	601512	中新集团	3,300	25,146.00	0.01
204	601168	西部矿业	1,400	25,130.00	0.01
205	688363	华熙生物	444	25,117.08	0.01
206	600971	恒源煤电	2,100	25,074.00	0.01
207	000963	华东医药	900	25,029.00	0.01
208	002001	新和成	1,300	24,960.00	0.01

209	600338	西藏珠峰	2,700	24,948.00	0.01
210	603348	文灿股份	900	24,921.00	0.01
211	300661	圣邦股份	300	24,834.00	0.01
212	000155	川能动力	2,300	24,771.00	0.01
213	002034	旺能环境	1,900	24,719.00	0.01
214	002706	良信股份	3,600	24,696.00	0.01
215	003035	南网能源	5,600	24,640.00	0.01
216	300119	瑞普生物	1,800	24,516.00	0.01
217	002507	涪陵榨菜	2,000	24,500.00	0.01
218	300596	利安隆	900	24,417.00	0.01
219	600388	龙净环保	2,100	24,381.00	0.01
220	600664	哈药股份	9,200	24,288.00	0.01
221	002701	奥瑞金	5,800	24,128.00	0.01
222	600256	广汇能源	3,600	24,120.00	0.01
223	002140	东华科技	3,100	24,025.00	0.01
224	603699	纽威股份	1,400	23,968.00	0.01
225	300821	东岳硅材	3,500	23,940.00	0.01
226	002057	中钢天源	3,400	23,800.00	0.01
227	002979	雷赛智能	1,300	23,660.00	0.01
228	000913	钱江摩托	1,500	23,640.00	0.01
229	688289	圣湘生物	1,342	23,592.36	0.01
230	600089	特变电工	1,700	23,579.00	0.01
231	300634	彩讯股份	1,400	23,562.00	0.01
232	688690	纳微科技	1,356	23,553.72	0.01
233	000860	顺鑫农业	1,400	23,436.00	0.01
234	002125	湘潭电化	2,400	23,352.00	0.01
235	300782	卓胜微	300	23,322.00	0.01
236	002531	天顺风能	2,600	23,244.00	0.01
237	600153	建发股份	2,600	23,218.00	0.01
238	002372	伟星新材	1,500	23,130.00	0.01
239	603128	华贸物流	4,000	23,080.00	0.01
240	000030	富奥股份	4,700	23,077.00	0.01
241	688484	南芯科技	622	23,076.20	0.01
242	603155	新亚强	2,100	23,016.00	0.01
243	002961	瑞达期货	2,100	22,995.00	0.01
244	300316	晶盛机电	800	22,984.00	0.01
245	600438	通威股份	1,200	22,932.00	0.01
246	301327	华宝新能	400	22,920.00	0.01
247	600499	科达制造	2,700	22,761.00	0.01
248	300432	富临精工	3,500	22,540.00	0.01
249	600862	中航高科	1,200	22,536.00	0.01
250	600335	国机汽车	3,900	22,503.00	0.01
251	600479	千金药业	2,200	22,374.00	0.01

252	603039	泛微网络	700	22,232.00	0.01
253	600596	新安股份	2,900	22,040.00	0.01
254	300724	捷佳伟创	400	21,604.00	0.01
255	603156	养元饮品	1,000	21,270.00	0.01
256	002326	永太科技	2,700	21,114.00	0.01
257	300969	恒帅股份	300	20,739.00	0.01
258	603599	广信股份	1,700	20,621.00	0.01
259	300390	天华新能	1,200	20,616.00	0.01
260	603806	福斯特	1,400	20,580.00	0.01
261	603185	弘元绿能	1,200	20,508.00	0.01
262	000538	云南白药	400	20,460.00	0.01
263	300769	德方纳米	700	19,740.00	0.01
264	002557	洽洽食品	700	19,733.00	0.01

#### 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	600519	贵州茅台	1,493,828.00	0.35
2	600036	招商银行	1,488,211.00	0.35
3	600583	海油工程	1,456,811.00	0.34
4	601658	邮储银行	1,343,573.00	0.31
5	002142	宁波银行	1,223,417.00	0.28
6	688111	金山办公	1,162,264.36	0.27
7	001965	招商公路	1,039,902.00	0.24
8	601899	紫金矿业	965,393.00	0.22
9	601857	中国石油	938,099.00	0.22
10	601728	中国电信	912,088.00	0.21
11	300677	英科医疗	904,870.40	0.21
12	601398	工商银行	877,034.00	0.20
13	002557	洽洽食品	847,570.00	0.20
14	600373	中文传媒	833,298.00	0.19
15	600887	伊利股份	828,380.00	0.19
16	000895	双汇发展	806,408.00	0.19
17	600276	恒瑞医药	768,644.00	0.18
18	002475	立讯精密	754,684.00	0.18
19	600482	中国动力	752,915.00	0.18
20	605090	九丰能源	735,182.00	0.17

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(%)
----	------	------	----------	----------------



	码			
1	300677	英科医疗	2,208,872.80	0.51
2	688111	金山办公	2,149,578.90	0.50
3	600887	伊利股份	1,988,872.00	0.46
4	600582	天地科技	1,650,840.00	0.38
5	000166	申万宏源	1,634,581.00	0.38
6	002352	顺丰控股	1,475,200.00	0.34
7	603225	新凤鸣	1,405,602.00	0.33
8	600547	山东黄金	1,341,647.00	0.31
9	600482	中国动力	1,306,802.00	0.30
10	600036	招商银行	1,281,479.00	0.30
11	601658	邮储银行	1,280,855.00	0.30
12	002557	洽洽食品	1,261,134.00	0.29
13	601728	中国电信	1,256,703.00	0.29
14	600030	中信证券	1,242,568.00	0.29
15	301389	隆扬电子	1,235,492.00	0.29
16	601857	中国石油	1,177,363.00	0.27
17	002142	宁波银行	1,172,335.00	0.27
18	600754	锦江酒店	1,161,796.00	0.27
19	688981	中芯国际	1,147,394.55	0.27
20	601865	福莱特	1,096,350.00	0.26

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	87,288,775.74
卖出股票收入（成交）总额	127,769,430.91

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,027,695.15	5.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	136,700,365.32	60.50
	其中：政策性金融债	43,537,112.55	19.27
4	企业债券	20,539,104.12	9.09
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,307,627.13	18.28
7	可转债（可交换债）	58,811,347.46	26.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	269,386,139.18	119.23
----	----	----------------	--------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	09230220	23 国开清发 20	200,000	22,381,918.03	9.91
2	019733	24 国债 02	119,000	12,027,695.15	5.32
3	102101296	21 宿迁城投 MTN003	100,000	10,615,214.21	4.70
4	2120110	21 北京银行永 续债 02	100,000	10,604,708.20	4.69
5	200205	20 国开 05	100,000	10,588,043.84	4.69

## 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

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

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

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	33,952.37
2	应收清算款	338,562.88

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	915.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	373,430.67

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	2,483,595.55	1.10
2	113042	上银转债	2,347,357.92	1.04
3	110067	华安转债	2,292,611.63	1.01
4	113037	紫银转债	2,065,398.30	0.91
5	127045	牧原转债	2,048,627.12	0.91
6	113056	重银转债	1,503,244.21	0.67
7	113043	财通转债	1,500,591.58	0.66
8	110073	国投转债	1,419,022.09	0.63
9	113045	环旭转债	1,217,587.95	0.54
10	127067	恒逸转 2	1,195,959.10	0.53
11	127016	鲁泰转债	1,055,559.45	0.47
12	118024	冠宇转债	1,034,036.96	0.46
13	113579	健友转债	1,029,609.13	0.46
14	113641	华友转债	1,001,479.43	0.44
15	123108	乐普转 2	997,647.62	0.44
16	113065	齐鲁转债	951,880.10	0.42
17	113049	长汽转债	942,531.51	0.42
18	127035	濮耐转债	940,590.35	0.42
19	113021	中信转债	880,241.99	0.39
20	110089	兴发转债	875,432.73	0.39
21	123224	宇邦转债	803,086.56	0.36
22	123212	立中转债	793,144.60	0.35
23	113616	韦尔转债	773,528.03	0.34
24	113545	金能转债	753,670.76	0.33
25	113615	金诚转债	745,927.06	0.33
26	110048	福能转债	745,426.49	0.33
27	113059	福莱转债	726,321.97	0.32
28	113666	爱玛转债	699,618.58	0.31
29	127066	科利转债	699,281.83	0.31
30	127041	弘亚转债	698,147.70	0.31
31	127038	国微转债	694,032.57	0.31
32	113673	岱美转债	674,158.58	0.30
33	111017	蓝天转债	672,455.91	0.30

34	113047	旗滨转债	619,533.34	0.27
35	118034	晶能转债	617,954.37	0.27
36	123133	佩蒂转债	611,322.59	0.27
37	113050	南银转债	605,740.36	0.27
38	118028	会通转债	589,064.70	0.26
39	111010	立昂转债	562,208.47	0.25
40	127073	天赐转债	560,739.73	0.25
41	110062	烽火转债	558,136.58	0.25
42	118012	微芯转债	497,308.85	0.22
43	113064	东材转债	494,774.58	0.22
44	123188	水羊转债	493,947.87	0.22
45	118037	上声转债	487,923.55	0.22
46	118013	道通转债	487,643.94	0.22
47	123211	阳谷转债	483,990.19	0.21
48	110068	龙净转债	482,726.07	0.21
49	127085	韵达转债	478,939.41	0.21
50	123114	三角转债	473,204.73	0.21
51	127078	优彩转债	455,375.73	0.20
52	118043	福立转债	454,965.21	0.20
53	123178	花园转债	454,339.46	0.20
54	113648	巨星转债	450,481.10	0.20
55	110082	宏发转债	450,228.29	0.20
56	123221	力诺转债	447,300.87	0.20
57	123213	天源转债	440,573.04	0.20
58	113623	凤 21 转债	438,415.42	0.19
59	113627	太平转债	436,357.63	0.19
60	123101	拓斯转债	428,565.35	0.19
61	123170	南电转债	422,406.60	0.19
62	123191	智尚转债	416,374.18	0.18
63	127101	豪鹏转债	404,958.96	0.18
64	127056	中特转债	395,805.54	0.18
65	127051	博杰转债	387,678.97	0.17
66	123228	震裕转债	372,917.02	0.17
67	113069	博 23 转债	365,764.21	0.16
68	113671	武进转债	345,271.55	0.15
69	118046	诺泰转债	333,102.23	0.15
70	127084	柳工转 2	328,610.15	0.15
71	127099	盛航转债	297,555.95	0.13
72	110077	洪城转债	288,756.29	0.13
73	127090	兴瑞转债	272,691.72	0.12
74	113637	华翔转债	265,072.30	0.12
75	113662	豪能转债	255,716.29	0.11
76	113674	华设转债	253,296.39	0.11

77	113678	中贝转债	252,162.22	0.11
78	113039	嘉泽转债	235,419.86	0.10
79	113658	密卫转债	227,813.90	0.10
80	110085	通 22 转债	217,880.05	0.10
81	113582	火炬转债	207,555.01	0.09
82	113669	景 23 转债	117,770.53	0.05
83	110083	苏租转债	113,635.41	0.05
84	111003	聚合转债	113,208.19	0.05
85	128087	孚日转债	111,785.53	0.05
86	118009	华锐转债	110,998.30	0.05
87	127074	麦米转 2	107,915.42	0.05

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.11.6 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 (%)
2,078	94,567.19	157,111,326.72	79.95	39,399,284.18	20.05

### 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	315,383.67	0.16

### 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 (2008 年 12 月 3 日) 基金份额总额	2,466,876,891.58
本报告期期初基金份额总额	376,271,293.23

本报告期基金总申购份额	635,034.31
减：本报告期基金总赎回份额	180,395,716.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	196,510,610.90

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	

			(%)		(%)	
第一创业	2	72,126,576.56	33.54	68,225.51	35.27	-
长江证券	2	32,186,344.88	14.97	30,445.00	15.74	-
海通证券	2	26,743,054.80	12.44	19,947.66	10.31	-
东方证券	3	20,769,814.57	9.66	19,646.37	10.15	-
中信建投	1	18,727,110.01	8.71	17,713.75	9.16	-
民生证券	2	15,278,610.40	7.10	13,456.28	6.96	-
银河证券	1	8,199,422.73	3.81	6,088.56	3.15	-
招商证券	2	6,162,425.80	2.87	5,828.98	3.01	-
东北证券	5	5,129,033.50	2.38	4,851.50	2.51	-
广发证券	2	3,836,529.00	1.78	2,861.26	1.48	-
华泰证券	3	3,251,234.40	1.51	2,425.14	1.25	-
东兴证券	3	2,648,050.00	1.23	1,975.10	1.02	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	撤销 1个 交易 单元
宏信证券	2	-	-	-	-	-

红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	撤销 2个 交易 单元
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	3	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
申万宏源 西部	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	4	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------



称	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 (%)
第一创业	325,216,213.59	45.18	1,814,444,000.00	31.00	-	-
长江证券	78,176,447.55	10.86	1,245,988,000.00	21.29	-	-
海通证券	108,776,786.25	15.11	141,000,000.00	2.41	-	-
东方证券	26,955,421.24	3.74	23,000,000.00	0.39	-	-
中信建投	72,463,007.19	10.07	1,724,658,000.00	29.47	-	-
民生证券	32,750,564.35	4.55	40,400,000.00	0.69	-	-
银河证券	22,784,865.16	3.17	781,168,000.00	13.35	-	-
招商证券	14,087,632.03	1.96	7,500,000.00	0.13	-	-
东北证券	19,925,354.13	2.77	63,710,000.00	1.09	-	-
广发证券	7,202,097.68	1.00	-	-	-	-
华泰证券	5,314,136.18	0.74	9,000,000.00	0.15	-	-
东兴证券	6,194,528.67	0.86	1,500,000.00	0.03	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证	-	-	-	-	-	-

券						
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国新证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
红塔证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
申万宏 源西部	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-

证券						
天风证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-
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	《银华增强收益债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 1 月 19 日
3	《银华增强收益债券型证券投资基金 2023 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
4	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 3 月 29 日
5	《银华增强收益债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 19 日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 1 季度报告提示性公	四大证券报	2024 年 4 月 19 日

	告》		
7	《银华增强收益债券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	2024 年 5 月 10 日
8	《银华增强收益债券型证券投资基金招募说明书更新(2024 年第 1 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 5 月 10 日
9	《银华增强收益债券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	2024 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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增强收益债券型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华增强收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华增强收益债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华增强收益债券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

2024 年 8 月 31 日