

银华专精特新量化优选股票型发起式证券
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	20
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
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	55
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
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	银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	银华专精特新量化优选股票发起式	
基金主代码	014668	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 20 日	
基金管理人	银华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	30,282,629.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	银华专精特新量化优选股票发起式 A	银华专精特新量化优选股票发起式 C
下属分级基金的交易代码	014668	014669
报告期末下属分级基金的份额总额	24,468,083.19 份	5,814,546.63 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有核心竞争力的“专精特新”优质公司，捕捉重点产业链环节的关键投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金所指的“专精特新”相关上市公司的企业规模符合国家《中小企业划型标准》（工信部联企业【2011】300号）及其修订的规定，并符合《关于促进中小企业健康发展的指导意见》、《工业和信息化部关于促进中小企业“专精特新”发展的指导意见》要求。“专精特新”主题相关上市公司为工信部公示的专精特新“小巨人”名单中的上市企业及其更新。</p> <p>若上述名单内容或名称修订，则以修订后的名单为准；若未来由于技术进步或政策变化导致本基金专精特新主题相关领域和公司相关业务的覆盖范围发生变动，则基金管理人将在履行适当程序后对上述主题界定进行调整、补充和修订。</p> <p>本基金主要投资于符合“专精特新”主题的上市公司股票，使用主动量化策略对“专精特新”主题界定内的股票进行筛选并进行权重的优化，力争在跟踪“专精特新”主题表现的同时，获得相对于业绩比较基准的超额收益。</p> <p>为实现上述投资目标，本基金使用多种量化选股策略进行股票投资，其投资逻辑如下：</p> <p>1) 价值成长策略。2) 超跌反转策略。3) 盈利惊喜策略。4) 分析师精选策略。5) 事件驱动策略。</p> <p>本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于“专精特新”主题上市公司发行的股票占非现金基</p>

	金资产的比例不低于 80%；投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*85%+商业银行活期存款利率(税后)*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，如投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨文辉	郭明
	联系电话	(010) 58163000	(010) 66105799
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006783333, (010) 85186558	95588
传真		(010) 58163027	(010) 66105798
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	陈四清

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(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	银华专精特新量化优选股票发起式 A	银华专精特新量化优选股票发起式 C
本期已实现收益	1,190,922.74	324,224.19
本期利润	2,769,189.99	658,840.15
加权平均基金份额本期利润	0.1066	0.0985
本期加权平均净值利润率	10.78%	9.96%
本期基金份额净值增长率	10.38%	10.22%
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	119,180.47	11,936.65
期末可供分配基金份额利润	0.0049	0.0021
期末基金资产净值	24,669,624.63	5,845,813.02
期末基金份额净值	1.0082	1.0054
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	0.82%	0.54%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银华专精特新量化优选股票发起式 A

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	2.61%	1.11%	0.79%	0.92%	1.82%	0.19%
过去三个月	0.27%	1.11%	-3.42%	0.81%	3.69%	0.30%
过去六个月	10.38%	1.02%	4.34%	0.78%	6.04%	0.24%
自基金合同生效 起至今	0.82%	1.07%	-4.80%	0.97%	5.62%	0.10%

银华专精特新量化优选股票发起式 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	2.58%	1.11%	0.79%	0.92%	1.79%	0.19%
过去三个月	0.20%	1.11%	-3.42%	0.81%	3.62%	0.30%
过去六个月	10.22%	1.02%	4.34%	0.78%	5.88%	0.24%
自基金合同生效 起至今	0.54%	1.07%	-4.80%	0.97%	5.34%	0.10%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*85%+商业银行活期存款利率(税后)*10%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%

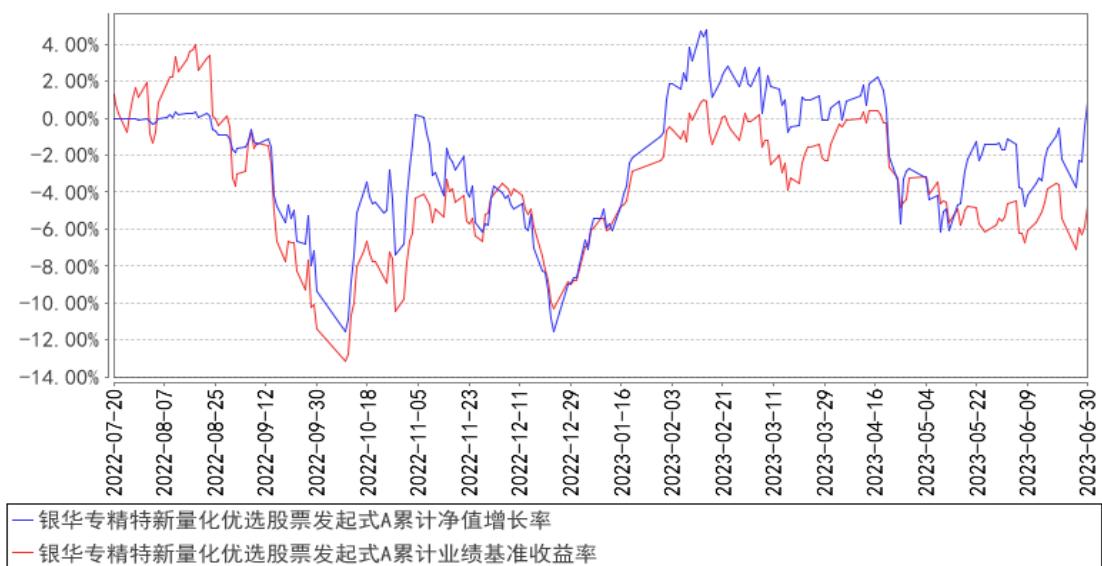
中证 1000 指数是由一批规模偏小且流动性较好的股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现，具有良好的市场代表性，适合作为本基金 A 股投资部分的业绩比较基准。

中证港股通综合指数（人民币）选取符合港股通资格的普通股作为样本股，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势，适合作为本基金港股通标的股票投资部分的业绩比较基准。

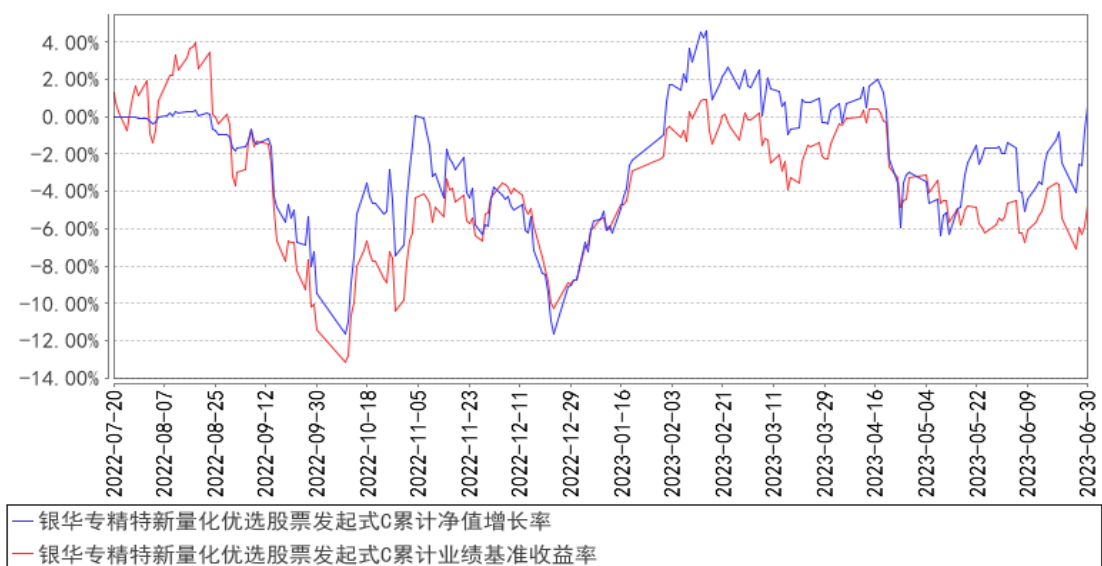
本基金是股票型基金，基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中，港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的 50%；其余资产投资于债券及其它具有高流动性的短期金融工具。总之，基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够较好地反映本基金的风险收益特征。

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

银华专精特新量化优选股票发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



银华专精特新量化优选股票发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2022 年 07 月 20 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于“专精特新”主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§ 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-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、银华尊享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		
李宜璇女士	本基金的基金经理	2022 年 7 月 20 日	-	9 年	博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014 年 12 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2017 年 12 月 25 日起担任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 1 月 13 日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券

				<p>投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 10 月 29 日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 5 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 25 日起兼任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基金经理，自 2021 年 6 月 24 日至 2021 年 12 月 21 日兼任银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 26 日起兼任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基金经理，自 2022 年 1 月 17 日起兼任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基金经理，自 2022 年 4 月 7 日起兼任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）基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则

管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年上半年,国内经济在一季度脉冲式经济反弹之后,出现明显的回落。进入四月份,投资、消费等数据均呈现走弱迹象。海外方面,美联储持续加息进程,以压制通胀,人民币汇率呈现贬值趋势。在上述因素的作用下,A股市场主要指数在上半年有所回落。上半年创业板下跌5.6%,沪深300下跌0.8%,中证1000上涨5.1%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华专精特新量化优选股票发起式A基金份额净值为1.0082元,本报告期基金份额净值增长率为10.38%;截至本报告期末银华专精特新量化优选股票发起式C基金份额净值为1.0054元,本报告期基金份额净值增长率为10.22%;业绩比较基准收益率为4.34%。

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,从经济场景的恢复,到经济活动的扩展,再到收入水平的提升,都将是一个缓慢但可持续的过程。未来一段时期,国内政策、外需出口、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量,我们也将对此进行持续的观察。我们将运用自行开发的量化投资管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式优化和调整组合,力争在基准上实现较好的超额收益。

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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情形的时间范围为 2022 年 7 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。由于本基金属于发起式基金，无需向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、

准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金

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	1,714,402.52	1,988,523.73
结算备付金		100,647.71	130,530.77
存出保证金		3,551.15	6,358.69
交易性金融资产	6.4.7.2	28,926,579.30	31,449,322.35
其中：股票投资		28,926,579.30	31,449,322.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,297.19	1,496.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		30,751,477.87	33,576,232.25
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		-	-
应付赎回款		24,296.22	759.44
应付管理人报酬		36,625.44	44,253.25
应付托管费		6,104.23	7,375.56
应付销售服务费		1,404.03	1,821.92
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	167,610.30	132,689.82
负债合计		236,040.22	186,899.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	30,282,629.82	36,565,116.28
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	232,807.83	-3,175,784.02
净资产合计		30,515,437.65	33,389,332.26
负债和净资产总计		30,751,477.87	33,576,232.25

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 30,282,629.82 份，其中银华专精特新量化优选股票发起式 A 基金份额总额 24,468,083.19 份，基金份额净值 1.0082 元。银华专精特新量化优选股票发起式 C 基金份额总额 5,814,546.63 份，基金份额净值 1.0054 元。

6.2 利润表

会计主体：银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金

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
一、营业总收入		3,769,273.43
1. 利息收入		5,170.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,170.25
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）		1,842,521.01
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,642,117.90
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	200,403.11
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,912,883.21
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	8,698.96
减：二、营业总支出		341,243.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	240,518.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	40,086.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,824.54
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	50,814.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,428,030.14
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,428,030.14
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,428,030.14

注：本基金合同生效日为 2022 年 07 月 20 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金

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）	36,565,116.28	-	-3,175,784.02	33,389,332.26
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)	36,565,116.28	-	-3,175,784.02	33,389,332.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,282,486.46	-	3,408,591.85	-2,873,894.61
(一)、综合收益总额	-	-	3,428,030.14	3,428,030.14
(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)	-6,282,486.46	-	-19,438.29	-6,301,924.75
其中：1. 基金申购款	4,474,137.96	-	52,887.58	4,527,025.54
2. 基金赎回款	-10,756,624.42	-	-72,325.87	-10,828,950.29
(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)	30,282,629.82	-	232,807.83	30,515,437.65

注：本基金合同生效日为 2022 年 07 月 20 日，无上年度可比期间数据。

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

银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2021]1741号《关于准予银华中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》和证监许可[2021]3889号《关于准予银华中证香港

科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)变更注册的批复》注册，由银华基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 41,102,421.50 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0451 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 7 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 41,114,577.73 份基金份额，其中认购资金利息折合 12,156.23 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,002,000.20 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据所收取的认购/申购费用与销售服务费用方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、可交换债券等以及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、现金、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货和股票期权)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于“专精特新”主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的

交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*85%+商业银行活期存款利率(税后)*10%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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资产变动情况。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有

关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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	1,714,402.52
等于：本金	1,714,235.96
加：应计利息	166.56
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	1,714,402.52

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	28,798,065.94	-	28,926,579.30	128,513.36
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	28,798,065.94	-	28,926,579.30	128,513.36

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	1.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	68,018.37
其中：交易所市场	68,018.37
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,590.38
合计	167,610.30

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华专精特新量化优选股票发起式 A

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	28,880,110.96	28,880,110.96
本期申购	1,644,434.30	1,644,434.30
本期赎回（以“-”号填列）	-6,056,462.07	-6,056,462.07
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	24,468,083.19	24,468,083.19

银华专精特新量化优选股票发起式 C

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	7,685,005.32	7,685,005.32
本期申购	2,829,703.66	2,829,703.66
本期赎回（以“-”号填列）	-4,700,162.35	-4,700,162.35
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	5,814,546.63	5,814,546.63

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

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

银华专精特新量化优选股票发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,122,213.30	-1,378,651.09	-2,500,864.39
本期利润	1,190,922.74	1,578,267.25	2,769,189.99
本期基金份额交易产生的变动数	50,471.03	-117,255.19	-66,784.16
其中：基金申购款	-15,666.04	30,787.27	15,121.23
基金赎回款	66,137.07	-148,042.46	-81,905.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	119,180.47	82,360.97	201,541.44

银华专精特新量化优选股票发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-308,366.12	-366,553.51	-674,919.63
本期利润	324,224.19	334,615.96	658,840.15
本期基金份额交易产生的变动数	-3,921.42	51,267.29	47,345.87
其中：基金申购款	-31,037.44	68,803.79	37,766.35
基金赎回款	27,116.02	-17,536.50	9,579.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,936.65	19,329.74	31,266.39

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	4,106.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,020.05
其他	43.25
合计	5,170.25

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	1,642,117.90
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	1,642,117.90

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	97,600,633.26
减：卖出股票成本总额	95,682,457.45
减：交易费用	276,057.91
买卖股票差价收入	1,642,117.90

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	200,403.11
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	200,403.11

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	1,912,883.21
股票投资	1,912,883.21
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,912,883.21

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	7,503.70
基金转换费收入	1,195.26
合计	8,698.96

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	24,795.19
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	1,224.00
合计	50,814.38

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
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 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	240,518.02
其中：支付销售机构的客户维护费	66,629.35

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	40,086.35

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法

定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华专精特新量化优选 股票发起式 A	银华专精特新量化优选 股票发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	412.68	412.68
中国工商银行	-	5,815.44	5,815.44
合计	-	6,228.12	6,228.12

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人代收后再分别支付给各个销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	银华专精特新量化优选股票发起式 A	银华专精特新量化优选股票发起式 C
基金合同生效日（2022 年 7 月 20 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,000.20	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,000.20	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	40.88%	-

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

2、对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,714,402.52	4,106.95

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末（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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相应对策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值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	1,714,402.52	-	-	-	1,714,402.52
结算备付金	100,647.71	-	-	-	100,647.71
存出保证金	3,551.15	-	-	-	3,551.15
交易性金融资产	-	-	-	28,926,579.30	28,926,579.30
应收申购款	-	-	-	6,297.19	6,297.19
资产总计	1,818,601.38	-	-	28,932,876.49	30,751,477.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,296.22	24,296.22
应付管理人报酬	-	-	-	36,625.44	36,625.44
应付托管费	-	-	-	6,104.23	6,104.23
应付销售服务费	-	-	-	1,404.03	1,404.03
其他负债	-	-	-	167,610.30	167,610.30
负债总计	-	-	-	236,040.22	236,040.22
利率敏感度缺口	1,818,601.38	-	-	28,696,836.27	30,515,437.65
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	1,988,523.73	-	-	-	1,988,523.73
结算备付金	130,530.77	-	-	-	130,530.77
存出保证金	6,358.69	-	-	-	6,358.69
交易性金融资产	-	-	-	31,449,322.35	31,449,322.35
应收申购款	-	-	-	1,496.71	1,496.71
资产总计	2,125,413.19	-	-	31,450,819.06	33,576,232.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	759.44	759.44
应付管理人报酬	-	-	-	44,253.25	44,253.25
应付托管费	-	-	-	7,375.56	7,375.56
应付销售服务费	-	-	-	1,821.92	1,821.92
其他负债	-	-	-	132,689.82	132,689.82
负债总计	-	-	-	186,899.99	186,899.99
利率敏感度缺口	2,125,413.19	-	-	31,263,919.07	33,389,332.26

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

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	28,926,579.30	94.79	31,449,322.35	94.19
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	28,926,579.30	94.79	31,449,322.35	94.19

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%	1,100,122.39	1,026,020.70
	业绩比较基准下降 5%	-1,100,122.39	-1,026,020.70

注：本期财务报表的实际编制期间为本基金合同生效日至本报告期末。

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	28,926,579.30	31,309,551.15
第二层次	-	139,771.20
第三层次	-	-
合计	28,926,579.30	31,449,322.35

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层

次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	28,926,579.30	94.07
	其中：股票	28,926,579.30	94.07
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	1,815,050.23	5.90
8	其他各项资产	9,848.34	0.03
9	合计	30,751,477.87	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	29,970.00	0.10
C	制造业	25,354,816.99	83.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	299,003.60	0.98
E	建筑业	177,549.60	0.58

F	批发和零售业	288,829.40	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	118,049.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	886,860.26	2.91
J	金融业	88,116.00	0.29
K	房地产业	19,494.00	0.06
L	租赁和商务服务业	31,833.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	727,007.67	2.38
N	水利、环境和公共设施管理业	886,979.78	2.91
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	18,070.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	28,926,579.30	94.79

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	300416	苏试试验	16,770	361,561.20	1.18
2	002698	博实股份	17,500	306,075.00	1.00
3	002997	瑞鹤模具	10,000	297,300.00	0.97
4	002833	弘亚数控	14,900	292,934.00	0.96
5	300884	狄耐克	21,000	278,040.00	0.91
6	688630	芯碁微装	3,272	274,913.44	0.90
7	688059	华锐精密	3,281	274,783.75	0.90
8	300839	博汇股份	20,220	268,723.80	0.88
9	603203	快克智能	8,100	249,318.00	0.82
10	300806	斯迪克	12,720	238,118.40	0.78
11	688800	瑞可达	3,794	235,797.10	0.77
12	300811	铂科新材	3,883	230,805.52	0.76
13	688186	广大特材	6,924	225,237.72	0.74
14	688310	迈得医疗	6,629	217,232.33	0.71
15	688328	深科达	6,355	212,765.40	0.70
16	300833	浩洋股份	1,900	207,917.00	0.68
17	603657	春光科技	11,700	205,335.00	0.67
18	688711	宏微科技	3,496	203,956.64	0.67
19	300481	濮阳惠成	9,500	195,320.00	0.64

20	688625	呈和科技	4,940	193,598.60	0.63
21	688665	四方光电	2,074	193,130.88	0.63
22	300631	久吾高科	5,300	185,394.00	0.61
23	300715	凯伦股份	12,500	177,250.00	0.58
24	688357	建龙微纳	2,703	174,857.07	0.57
25	002324	普利特	12,200	174,094.00	0.57
26	603290	斯达半导	800	172,160.00	0.56
27	688676	金盘科技	5,657	171,350.53	0.56
28	688208	道通科技	5,631	170,675.61	0.56
29	300775	三角防务	4,937	166,771.86	0.55
30	688355	明志科技	5,386	163,842.12	0.54
31	688398	赛特新材	4,793	163,680.95	0.54
32	300817	双飞股份	10,680	159,666.00	0.52
33	688312	燕麦科技	8,098	157,182.18	0.52
34	300470	中密控股	3,400	157,148.00	0.51
35	688308	欧科亿	3,898	155,920.00	0.51
36	002675	东诚药业	10,500	154,455.00	0.51
37	300414	中光防雷	15,518	153,628.20	0.50
38	688069	德林海	7,231	153,586.44	0.50
39	300971	博亚精工	5,800	152,250.00	0.50
40	603330	天洋新材	13,700	152,207.00	0.50
41	300425	中建环能	29,500	151,630.00	0.50
42	605305	中际联合	4,300	149,898.00	0.49
43	688519	南亚新材	6,212	149,274.36	0.49
44	002549	凯美特气	12,900	148,350.00	0.49
45	300993	玉马遮阳	12,920	147,934.00	0.48
46	688330	宏力达	4,197	147,230.76	0.48
47	300200	高盟新材	17,300	147,223.00	0.48
48	300758	七彩化学	14,700	145,971.00	0.48
49	688219	会通股份	15,281	145,933.55	0.48
50	300305	裕兴股份	13,400	144,720.00	0.47
51	688056	莱伯泰科	3,252	144,193.68	0.47
52	688210	统联精密	7,354	143,550.08	0.47
53	603098	森特股份	7,000	143,500.00	0.47
54	688626	翔宇医疗	3,116	141,809.16	0.46
55	002860	星帅尔	10,500	141,540.00	0.46
56	300190	维尔利	35,100	140,049.00	0.46
57	688020	方邦股份	2,792	139,516.24	0.46
58	688150	莱特光电	6,145	137,648.00	0.45
59	300587	天铁股份	17,800	137,060.00	0.45
60	688100	威胜信息	4,576	136,410.56	0.45
61	688190	云路股份	1,868	136,364.00	0.45
62	003029	吉大正元	4,200	136,290.00	0.45

63	603520	司太立	8,100	135,108.00	0.44
64	688510	航亚科技	6,765	134,555.85	0.44
65	688212	澳华内镜	1,979	134,374.10	0.44
66	688722	同益中	7,233	134,099.82	0.44
67	688135	利扬芯片	6,083	133,400.19	0.44
68	601702	华峰铝业	9,735	133,174.80	0.44
69	301087	可孚医疗	2,700	133,110.00	0.44
70	003038	鑫铂股份	3,200	132,672.00	0.43
71	002869	金溢科技	6,000	131,880.00	0.43
72	688179	阿拉丁	4,412	131,742.32	0.43
73	300780	德恩精工	7,200	129,744.00	0.43
74	688335	复洁环保	5,273	129,399.42	0.42
75	688138	清溢光电	6,103	128,834.33	0.42
76	688267	中触媒	6,041	127,283.87	0.42
77	300855	图南股份	3,510	123,973.20	0.41
78	688156	路德环境	4,302	123,338.34	0.40
79	300777	中简科技	2,600	122,876.00	0.40
80	301031	中熔电气	900	122,139.00	0.40
81	605016	百龙创园	4,900	121,324.00	0.40
82	603809	豪能股份	10,800	121,284.00	0.40
83	688368	晶丰明源	947	120,467.87	0.39
84	688025	杰普特	1,377	120,280.95	0.39
85	003031	中瓷电子	900	119,808.00	0.39
86	300586	美联新材	9,200	118,772.00	0.39
87	603489	八方股份	1,680	117,801.60	0.39
88	300593	新雷能	5,140	117,757.40	0.39
89	688077	大地熊	3,857	116,519.97	0.38
90	300718	长盛轴承	5,200	115,700.00	0.38
91	300179	四方达	10,800	114,480.00	0.38
92	002057	中钢天源	10,800	113,400.00	0.37
93	688598	金博股份	661	113,361.50	0.37
94	605389	长龄液压	3,900	112,593.00	0.37
95	688401	路维光电	2,997	112,507.38	0.37
96	300862	蓝盾光电	3,600	110,880.00	0.36
97	003025	思进智能	6,815	110,062.25	0.36
98	300842	帝科股份	1,200	109,728.00	0.36
99	688277	天智航	5,941	109,552.04	0.36
100	300950	德固特	5,100	108,120.00	0.35
101	300035	中科电气	8,900	106,978.00	0.35
102	603191	望变电气	5,500	106,975.00	0.35
103	688667	菱电电控	1,432	106,870.16	0.35
104	002810	山东赫达	5,900	106,200.00	0.35
105	688480	赛恩斯	3,425	106,038.00	0.35

106	002812	恩捷股份	1,100	105,985.00	0.35
107	688032	禾迈股份	298	105,834.70	0.35
108	002006	精工科技	4,905	105,800.85	0.35
109	300610	晨化股份	9,100	105,651.00	0.35
110	603109	神驰机电	5,900	105,315.00	0.35
111	688239	航宇科技	1,494	104,505.30	0.34
112	603267	鸿远电子	1,600	104,480.00	0.34
113	688200	华峰测控	682	104,346.00	0.34
114	688113	联测科技	2,171	103,947.48	0.34
115	688560	明冠新材	3,733	103,740.07	0.34
116	603678	火炬电子	3,000	103,380.00	0.34
117	603041	美思德	8,600	103,372.00	0.34
118	688092	爱科科技	3,453	103,141.11	0.34
119	688571	杭华股份	16,291	102,796.21	0.34
120	603579	荣泰健康	4,900	102,508.00	0.34
121	002996	顺博合金	8,400	101,640.00	0.33
122	300920	润阳科技	5,900	101,539.00	0.33
123	300980	祥源新材	5,000	100,550.00	0.33
124	688129	东来技术	7,199	100,282.07	0.33
125	002915	中欣氟材	6,000	100,260.00	0.33
126	300990	同飞股份	1,980	99,594.00	0.33
127	688350	富淼科技	5,844	99,289.56	0.33
128	300430	诚益通	6,000	99,060.00	0.32
129	688319	欧林生物	4,552	98,459.76	0.32
130	603396	金辰股份	1,500	98,400.00	0.32
131	688669	聚石化学	5,402	97,938.26	0.32
132	300827	上能电气	2,716	97,911.80	0.32
133	605123	派克新材	900	97,785.00	0.32
134	688010	福光股份	3,978	97,063.20	0.32
135	688290	景业智能	1,454	96,996.34	0.32
136	603185	弘元绿能	1,300	96,915.00	0.32
137	301268	铭利达	2,300	96,301.00	0.32
138	300653	正海生物	2,800	96,292.00	0.32
139	300661	圣邦股份	1,170	96,092.10	0.31
140	300213	佳讯飞鸿	14,400	96,048.00	0.31
141	688070	纵横股份	2,088	95,839.20	0.31
142	301129	瑞纳智能	1,300	95,771.00	0.31
143	300638	广和通	4,220	95,709.60	0.31
144	300853	申昊科技	2,700	94,770.00	0.31
145	688026	洁特生物	5,155	94,181.85	0.31
146	603681	永冠新材	6,500	92,820.00	0.30
147	301219	腾远钴业	2,470	92,279.20	0.30
148	300510	金冠股份	13,200	92,136.00	0.30

149	688060	云涌科技	1,668	91,906.80	0.30
150	688390	固德威	549	91,606.14	0.30
151	688617	惠泰医疗	243	90,821.25	0.30
152	300357	我武生物	2,700	90,801.00	0.30
153	605399	晨光新材	5,060	90,068.00	0.30
154	688618	三旺通信	1,322	89,525.84	0.29
155	688131	皓元医药	1,570	89,458.60	0.29
156	688580	伟思医疗	1,222	88,350.60	0.29
157	300762	上海瀚讯	7,500	88,275.00	0.29
158	002158	汉钟精机	3,500	87,360.00	0.29
159	300236	上海新阳	2,200	87,230.00	0.29
160	002803	吉宏股份	4,100	83,886.00	0.27
161	688019	安集科技	507	83,568.81	0.27
162	688120	华海清科	298	75,110.90	0.25
163	688039	当虹科技	2,050	73,472.00	0.24
164	688159	有方科技	1,695	67,088.10	0.22
165	603786	科博达	1,002	65,831.40	0.22
166	603127	昭衍新药	1,600	65,440.00	0.21
167	002979	雷赛智能	2,338	55,550.88	0.18
168	002930	宏川智慧	2,400	54,648.00	0.18
169	688065	凯赛生物	867	53,979.42	0.18
170	002829	星网宇达	1,200	52,716.00	0.17
171	688165	埃夫特	4,170	52,667.10	0.17
172	301206	三元生物	1,500	52,485.00	0.17
173	600459	贵研铂业	3,400	52,020.00	0.17
174	301150	中一科技	1,040	52,010.40	0.17
175	688323	瑞华泰	2,157	51,638.58	0.17
176	688170	德龙激光	1,125	50,366.25	0.17
177	688198	佰仁医疗	471	49,977.81	0.16
178	603256	宏和科技	6,200	49,848.00	0.16
179	688181	八亿时空	1,757	49,529.83	0.16
180	603663	三祥新材	3,300	49,335.00	0.16
181	300809	华辰装备	2,200	49,192.00	0.16
182	688155	先惠技术	904	49,051.04	0.16
183	300900	广联航空	1,700	48,977.00	0.16
184	688577	浙海德曼	1,023	48,674.34	0.16
185	603131	上海沪工	3,800	47,538.00	0.16
186	300956	英力股份	3,000	47,190.00	0.15
187	301080	百普赛斯	750	47,115.00	0.15
188	688311	盟升电子	667	46,649.98	0.15
189	300685	艾德生物	1,900	46,094.00	0.15
190	688011	新光光电	1,765	45,572.30	0.15
191	300648	星云股份	1,400	45,052.00	0.15

192	300065	海兰信	3,600	44,604.00	0.15
193	300896	爱美客	100	44,495.00	0.15
194	688112	鼎阳科技	843	44,493.54	0.15
195	688699	明微电子	878	44,180.96	0.14
196	603192	汇得科技	2,300	43,907.00	0.14
197	688377	迪威尔	1,746	43,737.30	0.14
198	688127	蓝特光学	2,461	43,387.43	0.14
199	300660	江苏雷利	1,100	42,020.00	0.14
200	688175	高凌信息	1,268	41,996.16	0.14
201	688508	芯朋微	712	41,288.88	0.14
202	688050	爱博医疗	200	41,066.00	0.13
203	688234	天岳先进	549	40,593.06	0.13
204	002068	黑猫股份	3,300	39,171.00	0.13
205	300421	力星股份	3,200	38,208.00	0.13
206	688188	柏楚电子	200	37,712.00	0.12
207	603611	诺力股份	1,400	36,876.00	0.12
208	688088	虹软科技	855	36,551.25	0.12
209	603867	新化股份	900	36,450.00	0.12
210	603730	岱美股份	2,270	35,866.00	0.12
211	301090	华润材料	2,800	35,336.00	0.12
212	603990	麦迪科技	1,600	35,280.00	0.12
213	600389	江山股份	1,450	34,437.50	0.11
214	688636	智明达	626	34,430.00	0.11
215	600452	涪陵电力	1,600	34,048.00	0.11
216	688063	派能科技	171	33,900.75	0.11
217	300719	安达维尔	2,400	33,888.00	0.11
218	002043	兔宝宝	3,100	33,821.00	0.11
219	601886	江河集团	3,800	33,782.00	0.11
220	002367	康力电梯	3,700	33,781.00	0.11
221	300902	国安达	900	33,705.00	0.11
222	605369	拱东医疗	600	33,624.00	0.11
223	688157	松井股份	636	33,453.60	0.11
224	688369	致远互联	603	33,345.90	0.11
225	603200	上海洗霸	1,600	33,328.00	0.11
226	300228	富瑞特装	5,200	33,280.00	0.11
227	601908	京运通	5,473	33,111.65	0.11
228	605208	永茂泰	3,300	33,066.00	0.11
229	000099	中信海直	3,500	33,040.00	0.11
230	300681	英搏尔	1,550	32,999.50	0.11
231	688551	科威尔	500	32,790.00	0.11
232	603507	振江股份	900	32,634.00	0.11
233	002918	蒙娜丽莎	2,100	32,424.00	0.11
234	603129	春风动力	200	32,380.00	0.11

235	603393	新天然气	1,200	32,208.00	0.11
236	301122	采纳股份	900	32,058.00	0.11
237	603630	拉芳家化	2,000	31,940.00	0.10
238	002334	英威腾	2,500	31,850.00	0.10
239	300662	科锐国际	900	31,833.00	0.10
240	300420	五洋停车	9,700	31,816.00	0.10
241	688089	嘉必优	1,066	31,766.80	0.10
242	600172	黄河旋风	7,400	31,672.00	0.10
243	300887	谱尼测试	800	31,664.00	0.10
244	300382	斯莱克	2,390	31,524.10	0.10
245	002895	川恒股份	1,600	31,520.00	0.10
246	002169	智光电气	3,800	31,502.00	0.10
247	301263	泰恩康	1,500	31,320.00	0.10
248	300802	矩子科技	1,300	31,291.00	0.10
249	301099	雅创电子	600	31,236.00	0.10
250	002267	陕天然气	3,900	30,888.00	0.10
251	300673	佩蒂股份	2,200	30,800.00	0.10
252	600966	博汇纸业	5,200	30,784.00	0.10
253	603818	曲美家居	5,700	30,780.00	0.10
254	002976	瑞玛精密	1,100	30,767.00	0.10
255	300975	商络电子	4,300	30,745.00	0.10
256	300543	朗科智能	3,100	30,659.00	0.10
257	605368	蓝天燃气	3,180	30,432.60	0.10
258	300138	晨光生物	1,700	30,430.00	0.10
259	600033	福建高速	9,700	30,361.00	0.10
260	601827	三峰环境	4,100	30,340.00	0.10
261	605378	野马电池	1,300	30,303.00	0.10
262	600984	建设机械	6,700	30,284.00	0.10
263	300565	科信技术	1,800	30,276.00	0.10
264	600461	洪城环境	3,700	30,229.00	0.10
265	600320	振华重工	8,100	30,213.00	0.10
266	300505	川金诺	1,700	30,209.00	0.10
267	000852	石化机械	4,200	30,198.00	0.10
268	600163	中闽能源	5,400	30,132.00	0.10
269	601686	友发集团	4,400	30,096.00	0.10
270	600973	宝胜股份	6,200	30,070.00	0.10
271	603378	亚士创能	3,300	30,063.00	0.10
272	600168	武汉控股	5,000	30,050.00	0.10
273	000761	本钢板材	7,500	30,000.00	0.10
274	000552	甘肃能化	9,000	29,970.00	0.10
275	301207	华兰疫苗	900	29,934.00	0.10
276	002815	崇达技术	2,400	29,880.00	0.10
277	002479	富春环保	6,400	29,824.00	0.10

278	002258	利尔化学	2,300	29,693.00	0.10
279	300881	盛德鑫泰	900	29,655.00	0.10
280	600449	宁夏建材	1,900	29,564.00	0.10
281	300693	盛弘股份	800	29,536.00	0.10
282	000685	中山公用	3,900	29,523.00	0.10
283	603351	威尔药业	1,100	29,502.00	0.10
284	600908	无锡银行	5,500	29,480.00	0.10
285	000717	中南股份	10,600	29,468.00	0.10
286	601200	上海环境	3,100	29,419.00	0.10
287	002933	新兴装备	1,000	29,370.00	0.10
288	600797	浙大网新	4,100	29,274.00	0.10
289	002419	天虹股份	5,000	29,250.00	0.10
290	002099	海翔药业	3,400	29,206.00	0.10
291	300705	九典制药	1,100	29,073.00	0.10
292	603032	德新科技	840	29,013.60	0.10
293	300733	西菱动力	1,920	28,972.80	0.09
294	600327	大东方	6,200	28,830.00	0.09
295	688166	博瑞医药	1,307	28,740.93	0.09
296	002573	清新环境	5,200	28,652.00	0.09
297	000888	峨眉山 A	2,500	28,650.00	0.09
298	002063	远光软件	3,300	28,644.00	0.09
299	603208	江山欧派	780	28,407.60	0.09
300	603277	银都股份	1,300	28,392.00	0.09
301	002688	金河生物	6,000	28,320.00	0.09
302	600814	杭州解百	3,300	28,215.00	0.09
303	603948	建业股份	1,300	27,950.00	0.09
304	300767	震安科技	1,100	27,896.00	0.09
305	603811	诚意药业	2,240	27,843.20	0.09
306	301015	百洋医药	1,000	27,760.00	0.09
307	603612	索通发展	1,600	27,728.00	0.09
308	688029	南微医学	337	27,485.72	0.09
309	300866	安克创新	300	26,250.00	0.09
310	688002	睿创微纳	584	26,163.20	0.09
311	300856	科思股份	331	26,072.87	0.09
312	002025	航天电器	400	25,520.00	0.08
313	002959	小熊电器	300	25,050.00	0.08
314	603688	石英股份	218	24,817.12	0.08
315	000546	ST金圆	3,800	24,206.00	0.08
316	600129	太极集团	400	23,796.00	0.08
317	688606	奥泰生物	451	23,546.71	0.08
318	688526	科前生物	937	22,291.23	0.07
319	600363	联创光电	600	22,260.00	0.07
320	688499	利元亨	347	22,041.44	0.07

321	002984	森麒麟	700	22,022.00	0.07
322	300633	开立医疗	400	21,800.00	0.07
323	600161	天坛生物	800	21,720.00	0.07
324	603197	保隆科技	400	21,700.00	0.07
325	600642	申能股份	3,100	21,669.00	0.07
326	000921	海信家电	800	21,560.00	0.07
327	002832	比音勒芬	600	21,246.00	0.07
328	301039	中集车辆	1,600	21,168.00	0.07
329	603883	老百姓	700	20,895.00	0.07
330	002641	公元股份	3,700	20,868.00	0.07
331	002233	塔牌集团	2,700	20,844.00	0.07
332	600323	瀚蓝环境	1,100	20,823.00	0.07
333	002422	科伦药业	700	20,776.00	0.07
334	003006	百亚股份	1,200	20,736.00	0.07
335	603233	大参林	740	20,727.40	0.07
336	002283	天润工业	3,200	20,544.00	0.07
337	002444	巨星科技	925	20,239.00	0.07
338	000967	盈峰环境	4,000	20,200.00	0.07
339	600916	中国黄金	1,700	20,077.00	0.07
340	002056	横店东磁	1,100	20,031.00	0.07
341	600201	生物股份	2,100	19,971.00	0.07
342	600109	国金证券	2,300	19,941.00	0.07
343	002746	仙坛股份	2,500	19,700.00	0.06
344	603187	海容冷链	980	19,590.20	0.06
345	601108	财通证券	2,700	19,548.00	0.06
346	000739	普洛药业	1,100	19,514.00	0.06
347	600223	福瑞达	1,900	19,494.00	0.06
348	002737	葵花药业	800	19,472.00	0.06
349	603881	数据港	860	19,427.40	0.06
350	300702	天宇股份	800	19,416.00	0.06
351	600909	华安证券	4,100	19,147.00	0.06
352	603985	恒润股份	900	18,873.00	0.06
353	002987	京北方	860	18,851.20	0.06
354	603298	杭叉集团	800	18,840.00	0.06
355	300634	彩讯股份	700	18,480.00	0.06
356	002293	罗莱生活	1,600	18,400.00	0.06
356	002990	盛视科技	500	18,400.00	0.06
357	300747	锐科激光	600	18,288.00	0.06
358	300232	洲明科技	2,000	18,280.00	0.06
359	000528	柳工	2,300	18,170.00	0.06
360	603466	风语筑	1,300	18,070.00	0.06
361	300443	金雷股份	500	17,725.00	0.06
362	002563	森马服饰	2,800	17,416.00	0.06

363	600400	红豆股份	5,300	17,384.00	0.06
364	600398	海澜之家	2,500	17,200.00	0.06
365	300017	网宿科技	2,400	17,064.00	0.06
366	002518	科士达	400	16,004.00	0.05
367	688006	杭可科技	519	15,813.93	0.05
368	601311	骆驼股份	1,700	15,776.00	0.05
369	601222	林洋能源	1,900	15,561.00	0.05
370	601567	三星医疗	1,226	15,484.38	0.05
371	301155	海力风电	200	15,416.00	0.05
372	002991	甘源食品	200	15,340.00	0.05
373	603218	日月股份	800	15,192.00	0.05
374	603345	安井食品	100	14,680.00	0.05
375	300973	立高食品	200	13,684.00	0.04
376	002568	百润股份	300	10,905.00	0.04
377	600197	伊力特	400	10,868.00	0.04
378	605388	均瑶健康	800	10,168.00	0.03
379	002946	新乳业	700	10,045.00	0.03
380	603719	良品铺子	400	10,004.00	0.03
381	000729	燕京啤酒	800	9,976.00	0.03
382	603156	养元饮品	400	9,880.00	0.03
383	300783	三只松鼠	500	9,770.00	0.03
384	300146	汤臣倍健	400	9,592.00	0.03
385	603919	金徽酒	400	9,392.00	0.03
386	600597	光明乳业	900	9,360.00	0.03
387	601869	长飞光纤	100	3,701.00	0.01
388	300895	铜牛信息	70	2,338.00	0.01
389	603399	吉翔股份	200	2,314.00	0.01
390	300769	德方纳米	20	2,204.60	0.01
391	603920	世运电路	88	1,718.64	0.01
392	600933	爱柯迪	63	1,467.27	0.00
393	003033	征和工业	29	1,017.90	0.00
394	603078	江化微	50	829.50	0.00
395	002214	大立科技	55	750.75	0.00
396	002061	浙江交科	60	267.60	0.00
397	603115	海星股份	4	61.48	0.00
398	688788	科思科技	1	41.45	0.00
399	688022	瀚川智能	1	36.13	0.00
400	688315	诺禾致源	1	26.55	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	688700	东威科技	762,755.88	2.28
2	300820	英杰电气	726,858.64	2.18
3	603127	昭衍新药	627,798.00	1.88
4	002675	东诚药业	611,723.00	1.83
5	688037	芯源微	605,995.14	1.81
6	300839	博汇股份	605,343.00	1.81
7	300481	濮阳惠成	601,558.00	1.80
8	300685	艾德生物	590,116.00	1.77
9	603786	科博达	587,851.00	1.76
10	688085	三友医疗	570,260.34	1.71
11	688186	广大特材	568,423.86	1.70
12	688698	伟创电气	557,561.05	1.67
13	603995	甬金股份	538,004.00	1.61
14	688800	瑞可达	524,582.10	1.57
15	688308	欧科亿	524,394.04	1.57
16	688368	晶丰明源	522,103.29	1.56
17	300236	上海新阳	518,334.00	1.55
18	300416	苏试试验	516,888.00	1.55
19	688323	瑞华泰	508,630.12	1.52
20	300200	高盟新材	495,288.00	1.48

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	688037	芯源微	830,289.14	2.49
2	300820	英杰电气	826,724.00	2.48
3	605016	百龙创园	807,760.52	2.42
4	300236	上海新阳	782,034.73	2.34
5	300470	中密控股	769,138.29	2.30
6	300430	诚益通	756,726.00	2.27
7	688700	东威科技	749,277.82	2.24
8	603360	百傲化学	746,655.85	2.24
9	002675	东诚药业	725,824.14	2.17
10	605183	确成股份	693,983.06	2.08
11	600459	贵研铂业	685,848.73	2.05
12	603127	昭衍新药	683,045.47	2.05
13	002214	大立科技	654,100.92	1.96
14	688633	星球石墨	651,138.41	1.95
15	603786	科博达	647,466.20	1.94
16	300114	中航电测	638,017.89	1.91
17	688698	伟创电气	633,970.84	1.90
18	603995	甬金股份	605,117.04	1.81

19	002869	金溢科技	603,320.00	1.81
20	300481	濮阳惠成	586,378.00	1.76

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	91,246,831.19
卖出股票收入（成交）总额	97,600,633.26

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,551.15
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,297.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,848.34

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
银华专精特新量化优选股票发起式 A	838	29,198.19	10,496,104.68	42.90	13,971,978.51	57.10
银华专精特新量化优选股票发起式 C	655	8,877.17	-	-	5,814,546.63	100.00
合计	1,493	20,283.07	10,496,104.68	34.66	19,786,525.14	65.34

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	银华专精特新量化优选股票发起式 A	10.01	0.00
	银华专精特新量化优选股票发起式 C	-	-
	合计	10.01	0.00

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

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,000.20	33.03	10,002,000.20	33.03	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,000.20	33.03	10,002,000.20	33.03	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华专精特新量化优选股票发起式 A	银华专精特新量化优选股票发起式 C
基金合同生效日 （2022 年 7 月 20 日） 基金份额总额	32,522,008.26	8,592,569.47
本报告期期初基金	28,880,110.96	7,685,005.32

份额总额		
本报告期基金总申购份额	1,644,434.30	2,829,703.66
减：本报告期基金总赎回份额	6,056,462.07	4,700,162.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,468,083.19	5,814,546.63

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

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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 (%)	
中泰证券	4	74,142,221.31	39.26	69,047.63	42.21	-
东吴证券	2	61,377,603.05	32.50	44,886.08	27.44	-
国联证券	1	29,277,112.69	15.50	27,266.54	16.67	-
国海证券	2	23,908,902.37	12.66	22,266.52	13.61	-
瑞银证券	1	77,060.00	0.04	71.77	0.04	-
国盛证券	2	64,565.03	0.03	47.21	0.03	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	7	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	新增1个交易单元
平安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-

英大证券	3	-	-	-	-	新增 1个 交易 单元
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

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(%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国盛证	-	-	-	-	-	-

券						
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-

浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 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	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 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	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 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	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 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
7	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 2 日
8	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书更新 (2023 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	2023 年 6 月 2 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20230101-20230630	10,002,000.20	0.00	0.00	10,002,000.20	33.03

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

12.1.2 《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》

12.1.4 《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》

12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

银华基金管理股份有限公司

2023年8月29日