

银华益成大类资产（招行）

2023 年第 4 季度投资管理报告

填制机构：银华基金管理股份有限公司

报告期间：2023 年 10 月 01 日—2023 年 12 月 31 日

报送日期：2024 年 01 月 31 日

1、重要提示

资产管理计划托管人根据资产管理合同规定,于2022年4月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

2、投资管理人基本信息

名称	银华基金管理股份有限公司
地址	北京市东城区东长安街1号东方广场C2办公楼15层
法定代表人	王珠林
注册地址	广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层
联系方式	(010)58163000

3、组合投资收益情况

主要财务指标	报告期(2023年10月01日-2023年12月31日)
1. 本期已实现收益	-1,992,302.84
2. 本期利润	-1,730,527.90
3. 加权平均管理计划份额本期利润	-0.0718
4. 期末管理计划资产净值	28,980,740.17
5. 期末管理计划份额净值	1.0569

备注: -

4、计划的投资组合报告

4.1 投资资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占总资产的比例(%)
1	权益投资	27,032,003.00	93.16
	其中: 股票	27,032,003.00	93.16
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	基金投资	300.04	0.00
	其中: 基金投资-股票型	-	-
	基金投资-债券型	-	-
	基金投资-货币型	300.04	0.00
	基金投资-其他	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	600,000.00	2.07

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,136,733.36	3.92
7	其他资产	248,817.60	0.86
8	合计	29,017,854.00	100.00

备注：由于四舍五入的原因，市值占总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

4.2 按行业分类的股票投资组合

4.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	222,250.00	0.77
B	采矿业	334,433.00	1.15
C	制造业	15,844,932.00	54.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	539,060.00	1.86
E	建筑业	1,653,697.00	5.71
F	批发和零售业	1,422,763.00	4.91
G	交通运输、仓储和邮政业	313,201.00	1.08
H	住宿和餐饮业	271,348.00	0.94
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,911,864.00	10.05
J	金融业	230,065.00	0.79
K	房地产业	826,779.00	2.85
L	租赁和商务服务业	326,543.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	266,540.00	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	406,570.00	1.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	404,954.00	1.40
R	文化、体育和娱乐业	1,024,752.00	3.54
S	综合	32,252.00	0.11
	合计	27,032,003.00	93.28

备注：-

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-

工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
地产建筑业	-	-
合计	-	-

备注：本计划本报告期末未持有港股通股票。

4.3 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
1	600050	中国联通	145,500.00	637,290.00	2.20
2	600153	建发股份	55,900.00	538,317.00	1.86
3	601728	中国电信	96,500.00	522,065.00	1.80
4	605377	华旺科技	24,800.00	473,432.00	1.63
5	000951	中国重汽	31,900.00	426,184.00	1.47

备注：-

4.4 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

备注：本计划本报告期末未持有债券。

4.5 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名可转换债券投资明细

备注：本计划本报告期末未持有可转换债券。

4.6 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

备注：本计划本报告期末未持有资产支持证券。

4.7 报告期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	数量（份）	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
1	511690	大成添益交易型货币E	1.00	100.02	0.00
2	511660	建信现金添益货币H	1.00	100.01	0.00
3	511990	华宝添益货币A	1.00	100.01	0.00

备注：本计划本报告期末仅持有上述基金。

4.8 报告期末股指期货投资明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2403	IF2403	2.00	2,073,480.00	-1,980.00

总额合计				-1,980.00
减：可抵销期货暂收款				1,980.00
股指期货投资净额				-

备注：-

4.9 报告期末国债期货投资明细

备注：本计划本报告期末未持有国债期货。

4.10 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	248,817.60
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	0.00
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	248,817.60

备注：-

4.11 用杠杆情况（如有）

5、费用报告

5.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月01日至2023 年12月31日	上季度可比期间 2023年07月01日至2023 年09月30日
当期发生的资管计划应支付的管理费	19,512.18	20,361.39

备注：-

5.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月01日至2023 年12月31日	上季度可比期间 2023年07月01日至2023 年09月30日
当期发生的资管计划应支付的托管费	2,601.65	2,714.81

备注：-

5.3 业绩报酬

单位：人民币元

项目	本期 2023年10月01日至2023 年12月31日	上季度可比期间 2023年07月01日至2023 年09月30日
当期计提的业绩报酬	-	-

备注：本计划本报告期及上季度根据资产合同计算出无业绩报酬。

6、收益分配情况

备注：本计划本报告期无收益分配。

7、计划投资组合管理情况

7.1 本特定客户资产管理组合投资经理

7.2 说明投资管理人在报告期内，是否存在损害受托人、委托人、受益人利益的行为，是否存在关联关系和关联交易，是否勤勉尽责地管理基金资产，是否严格遵守了《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》及其他有关法律法规、投资管理合同的规定；若存在违法违规或未履行投资管理合同承诺的，应就有关情况作出具体说明，并提出处理方法

本投资管理人在本报告期内，在严格控制风险的基础上，为资产委托人谋求最大利益，无损害资产委托人利益的行为；勤勉尽责地管理和运用资产管理计划财产；严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》和其他有关法律法规的规定。依据审慎研究结果，本投资组合在本报告期内投资了本投资管理人认为的可能涉及关联交易的基金。上述投资决策过程严格按照《关联交易管理办法》及相关制度的规定，未存在涉嫌利益输送或其他违规事项。

7.3 说明投资管理人在报告期内，公平交易制度执行情况

本投资管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本投资管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本投资管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本投资管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本投资管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本投资管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本投资管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

7.4 投资回顾与展望

四季度中，经济运行整体态势与三季度相似，但也产生了一些新的变化点。相似之处在于，居民消费依然处于弱复苏的通道中，这在国庆黄金周的数据中得到明显体现；同时商务及投资活动仍然较为弱势，这在消费价位段、投融资结构等数据上有所显现。而新的变化点在于，随着美联储加息预期接近尾声，汇率和国际资本流动开始产生了一些新的变化，目前尚处于较为初期的阶段。在上述因素的作用下，A 股市场主要指数在四季度仍呈现回落。行业层面，煤炭、电子、农林牧渔等行业表现领先，房地产、建材、消费者服务等行业表现落后。

展望 2024 年一季度我们认为，经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生，我们正处于这样的进程中。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢但持续的过程。未来一段时期，国内政策、汇率水平、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

8、重大事项

无。

9、涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

9.1 投资经理变更

无。

9.2 公司关联人员的持有情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
刘少一	95.7561

9.3 重大关联交易情况

无。

9.4 报告期内开放期的相关说明

无。

9.5 其他

无。

10、其他需要说明的情况

无。

11、声明

郑重承诺报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。

银华基金管理股份有限公司
2023年12月31日