

银华专精特新量化优选股票型发起式证券
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§ 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	17
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	17
§ 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 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 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	27,340,408.06 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	20,664,701.91 份	6,675,706.15 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	廖林

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)	
	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	-1,795,707.13	-481,830.90
本期利润	-3,881,775.07	-1,045,669.75
加权平均基金份额 本期利润	-0.1788	-0.1568
本期加权平均净 值利润率	-21.71%	-19.16%
本期基金份额净 值增长率	-18.41%	-18.53%
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	-4,589,121.21	-1,512,749.68
期末可供分配基 金份额利润	-0.2221	-0.2266
期末基金资产净 值	16,075,580.70	5,162,956.47
期末基金份额净 值	0.7779	0.7734
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	-22.21%	-22.66%

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 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差	①—③	②—④

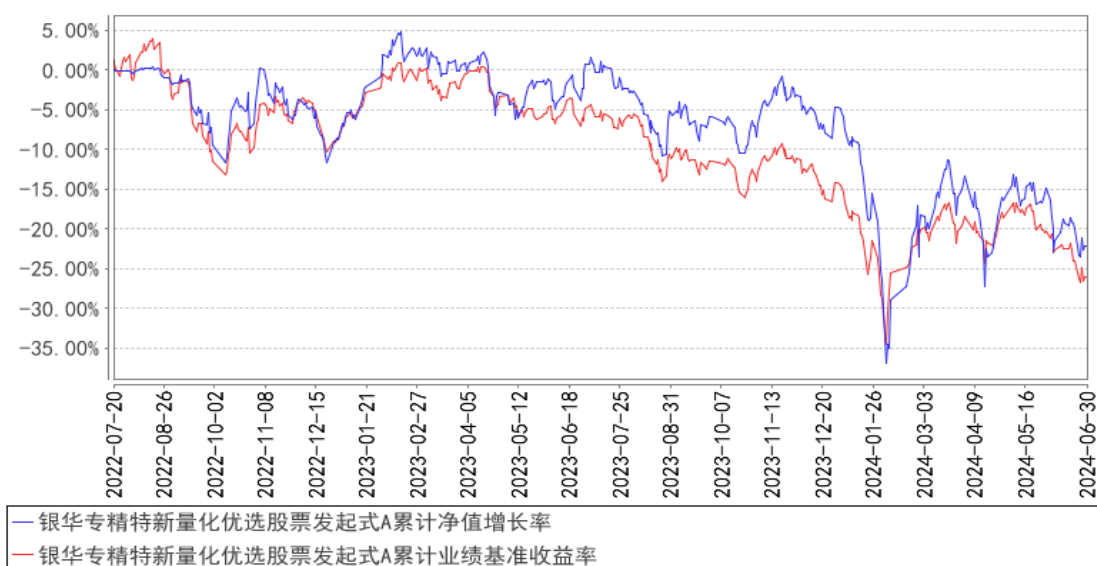
	率①	准差②		④		
过去一个月	-8.59%	1.84%	-7.39%	1.21%	-1.20%	0.63%
过去三个月	-8.49%	2.15%	-8.15%	1.30%	-0.34%	0.85%
过去六个月	-18.41%	2.61%	-13.99%	1.73%	-4.42%	0.88%
过去一年	-22.84%	1.96%	-22.38%	1.35%	-0.46%	0.61%
自基金合同生效起至今	-22.21%	1.59%	-26.10%	1.18%	3.89%	0.41%

银华专精特新量化优选股票发起式 C

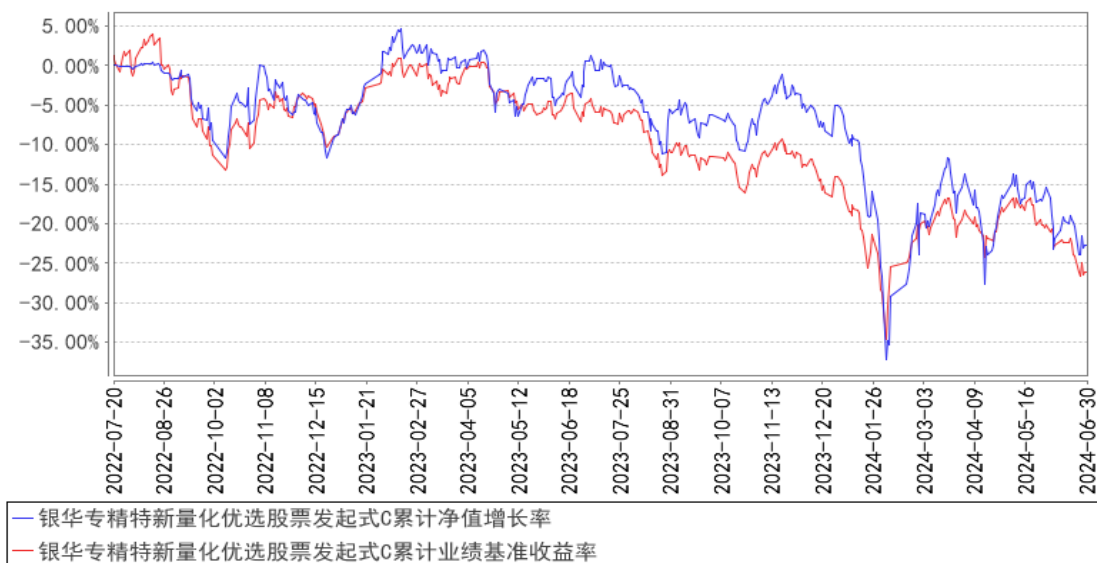
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-8.61%	1.85%	-7.39%	1.21%	-1.22%	0.64%
过去三个月	-8.56%	2.15%	-8.15%	1.30%	-0.41%	0.85%
过去六个月	-18.53%	2.61%	-13.99%	1.73%	-4.54%	0.88%
过去一年	-23.08%	1.96%	-22.38%	1.35%	-0.70%	0.61%
自基金合同生效起至今	-22.66%	1.59%	-26.10%	1.18%	3.44%	0.41%

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：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：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。

§ 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基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型基金中基金（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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型基金中基金、银华富饶精选三年持有期混合型基金中基金、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基金中基金 (FOF)、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、银华中债 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		
李宜璇女士	本基金的基金经理	2022 年 7 月 20 日	-	10 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

				<p>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，自 2024 年 6 月 13 日起兼任银华恒指港股通交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2024 年 8 月 23 日起兼任银华中证港股通高股息投资交易型开放式指数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

2024年上半年,宏观经济运行整体上呈现一季度上行、二季度小幅回落的节奏。对比一、二季度的经济表现经济运行依然延续了之前的趋势,从整体上呈现弱复苏的特征。伴随着春节效应的结束与消费进入传统淡季,我们能够看到一些与往年不同的特征:节假日消费与经济活动同比恢复良好,而非节假日期间的淡季特征则较为明显。这些特征一定程度上凸显出商务活动的复苏依旧相对落后于整体水平。海外方面,美联储降息周期比预期有所推迟,海外利率水平依旧在高位维持。在上述因素的作用下,2024年上半年A股市场主要相关指数表现如下,创业板下跌11.0%,沪深300微涨0.9%,中证1000下跌16.8%。

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0.7779元,本报告期基金份额净值增长率为-18.41%;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0.7734元,本报告期基金份额净值增长率为-18.53%;业绩比较基准收益率为-13.99%。

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2024年下半年,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。专精特新是国家政策扶持以及市场认可度高的共振方向。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 2024 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遵规守信情况声明

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 2024 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：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	1,751,708.62	1,648,277.55
结算备付金		69,244.41	-
存出保证金		2,905.18	1,742.82
交易性金融资产	6.4.7.2	19,662,382.01	25,581,437.11
其中：股票投资		19,662,382.01	25,277,912.73
基金投资		-	-
债券投资		-	303,524.38
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		6,045.51	11,700.08

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		21,492,285.73	27,243,157.56
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		170,679.30	72,845.49
应付管理人报酬		21,730.88	27,308.26
应付托管费		3,621.82	4,551.40
应付销售服务费		1,335.24	1,414.17
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	56,381.32	76,093.26
负债合计		253,748.56	182,212.58
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	27,340,408.06	28,410,085.95
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-6,101,870.89	-1,349,140.97
净资产合计		21,238,537.17	27,060,944.98
负债和净资产总计		21,492,285.73	27,243,157.56

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 27,340,408.06 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 20,664,701.91 份，基金份额净值 0.7779 元。银华专精特新量化优选股票发起式 C 基金份额总额 6,675,706.15 份，基金份额净值 0.7734 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：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
一、营业总收入		-4,744,361.41	3,769,273.43
1. 利息收入		4,161.02	5,170.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,161.02	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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,111,956.00	1,842,521.01
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,298,817.19	1,642,117.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,224.62	-
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	183,636.57	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	-2,649,906.79	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	13,340.36	8,698.96
减：二、营业总支出		183,083.41	341,243.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	138,514.25	240,518.02
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	23,085.71	40,086.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,087.03	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	13,396.42	50,814.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,927,444.82	3,428,030.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,927,444.82	3,428,030.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-4,927,444.82	3,428,030.14
----------	--	---------------	--------------

6.3 净资产变动表

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：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	28,410,085.95	-	-1,349,140.97	27,060,944.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	28,410,085.95	-	-1,349,140.97	27,060,944.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,069,677.89	-	-4,752,729.92	-5,822,407.81
（一）、综合收益总额	-	-	-4,927,444.82	-4,927,444.82
（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）	-1,069,677.89	-	174,714.90	-894,962.99
其中：1. 基金申购款	5,107,804.84	-	-1,028,059.03	4,079,745.81
2. 基金赎回款	-6,177,482.73	-	1,202,773.93	-4,974,708.80
（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	27,340,408.06	-	-6,101,870.89	21,238,537.17

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	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	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净资产变动数（净资产减少以“-”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	30,282,629.82	-	232,807.83	30,515,437.65

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20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 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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 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	1,751,708.62
等于：本金	1,751,554.87
加：应计利息	153.75
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	1,751,708.62

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	22,600,549.97	-	19,662,382.01	-2,938,167.96
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		22,600,549.97	-	19,662,382.01	-2,938,167.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	43,948.90
其中：交易所市场	43,948.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	12,432.42
合计	56,381.32

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 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	22,273,739.62	22,273,739.62
本期申购	1,114,646.95	1,114,646.95
本期赎回（以“-”号填列）	-2,723,684.66	-2,723,684.66
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	20,664,701.91	20,664,701.91

银华专精特新量化优选股票发起式 C

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	6,136,346.33	6,136,346.33
本期申购	3,993,157.89	3,993,157.89

本期赎回（以“-”号填列）	-3,453,798.07	-3,453,798.07
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	6,675,706.15	6,675,706.15

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	-870,432.87	-167,399.94	-1,037,832.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-870,432.87	-167,399.94	-1,037,832.81
本期利润	-1,795,707.13	-2,086,067.94	-3,881,775.07
本期基金份额交易产生的变动数	190,389.81	140,096.86	330,486.67
其中：基金申购款	-137,544.49	-62,956.90	-200,501.39
基金赎回款	327,934.30	203,053.76	530,988.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,475,750.19	-2,113,371.02	-4,589,121.21

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	-264,945.54	-46,362.62	-311,308.16
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-264,945.54	-46,362.62	-311,308.16
本期利润	-481,830.90	-563,838.85	-1,045,669.75
本期基金份额交易产生的变动数	-86,128.74	-69,643.03	-155,771.77
其中：基金申购款	-549,337.24	-278,220.40	-827,557.64
基金赎回款	463,208.50	208,577.37	671,785.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-832,905.18	-679,844.50	-1,512,749.68

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	3,455.20
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	686.75
其他	19.07
合计	4,161.02

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	-2,298,817.19
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	-2,298,817.19

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	65,576,500.65
减：卖出股票成本总额	67,729,794.89
减：交易费用	145,522.95
买卖股票差价收入	-2,298,817.19

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	3,135.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	89.00
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	3,224.62
----	----------

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	306,540.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	299,911.00
减：应计利息总额	6,540.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	89.00

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	183,636.57
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	183,636.57

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	-2,649,906.79
股票投资	-2,649,697.79
债券投资	-209.00
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	-2,649,906.79

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	12,585.92
基金转换费收入	754.44
合计	13,340.36

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	12,432.42
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	964.00
合计	13,396.42

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（“银华基金”）	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 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	138,514.25	240,518.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	36,097.00	66,629.35
应支付基金管理人的净管理费	102,417.25	173,888.67

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日，支付基金管理人银华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据《银华基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金管理人银华基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

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	23,085.71	40,086.35

注：自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 7 月 9 日，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

根据《银华基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费

率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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 2024年1月1日至2024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	-	433.34	433.34
中国工商银行	-	3,476.40	3,476.40
合计	-	3,909.74	3,909.74
获得销售服务费的各关联方名称	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	-	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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024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	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,000.20	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	48.40%	-
项目	上年度可比期间 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	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,000.20	-
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 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
中国工商银行	1,751,708.62	3,455.20	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（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

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	1,751,708.62	-	-	-	1,751,708.62
结算备付金	69,244.41	-	-	-	69,244.41
存出保证金	2,905.18	-	-	-	2,905.18
交易性金融资产	-	-	-	19,662,382.01	19,662,382.01
应收申购款	-	-	-	6,045.51	6,045.51
资产总计	1,823,858.21	-	-	19,668,427.52	21,492,285.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	170,679.30	170,679.30
应付管理人报酬	-	-	-	21,730.88	21,730.88
应付托管费	-	-	-	3,621.82	3,621.82
应付销售服务费	-	-	-	1,335.24	1,335.24
其他负债	-	-	-	56,381.32	56,381.32

负债总计	-	-	-	253,748.56	253,748.56
利率敏感度缺口	1,823,858.21	-	-	19,414,678.96	21,238,537.17
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	1,648,277.55	-	-	-	1,648,277.55
存出保证金	1,742.82	-	-	-	1,742.82
交易性金融资产	303,524.38	-	-	25,277,912.73	25,581,437.11
应收申购款	-	-	-	11,700.08	11,700.08
资产总计	1,953,544.75	-	-	25,289,612.81	27,243,157.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	72,845.49	72,845.49
应付管理人报酬	-	-	-	27,308.26	27,308.26
应付托管费	-	-	-	4,551.40	4,551.40
应付销售服务费	-	-	-	1,414.17	1,414.17
其他负债	-	-	-	76,093.26	76,093.26
负债总计	-	-	-	182,212.58	182,212.58
利率敏感度缺口	1,953,544.75	-	-	25,107,400.23	27,060,944.98

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 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	19,662,382.01	92.58	25,277,912.73	93.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	303,524.38	1.12
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	19,662,382.01	92.58	25,581,437.11	94.53

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%	1,022,261.86	1,172,862.97
	业绩比较基准下降 5%	-1,022,261.86	-1,172,862.97

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	19,662,382.01	25,260,114.73
第二层次	-	321,322.38
第三层次	-	-
合计	19,662,382.01	25,581,437.11

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	19,662,382.01	91.49
	其中：股票	19,662,382.01	91.49
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	1,820,953.03	8.47
8	其他各项资产	8,950.69	0.04
9	合计	21,492,285.73	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	18,946.00	0.09
B	采矿业	62,721.00	0.30
C	制造业	16,417,803.54	77.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	149,792.00	0.71
E	建筑业	84,283.00	0.40
F	批发和零售业	188,732.00	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	101,363.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,143,706.86	5.39
J	金融业	125,615.00	0.59
K	房地产业	20,759.00	0.10
L	租赁和商务服务业	33,894.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	374,574.11	1.76
N	水利、环境和公共设施管理业	882,666.50	4.16
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	57,526.00	0.27
S	综合	-	-
	合计	19,662,382.01	92.58

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	300643	万通智控	16,700	235,470.00	1.11
2	603507	振江股份	5,900	193,638.00	0.91
3	300531	优博讯	18,400	191,728.00	0.90
4	688135	利扬芯片	11,657	186,745.14	0.88
5	688681	科汇股份	18,087	184,668.27	0.87
6	688181	八亿时空	9,597	181,863.15	0.86
7	688613	奥精医疗	14,239	181,262.47	0.85
8	688317	之江生物	12,295	177,170.95	0.83
9	300470	中密控股	5,200	175,812.00	0.83
10	002380	科远智慧	9,600	175,680.00	0.83
11	300508	维宏股份	9,000	174,870.00	0.82
12	300587	天铁股份	42,900	173,316.00	0.82
13	688610	埃科光电	5,140	172,858.20	0.81
14	688291	金橙子	9,984	171,924.48	0.81
15	688077	大地熊	10,789	170,789.87	0.80
16	688267	中触媒	8,564	170,081.04	0.80
17	688625	呈和科技	4,632	168,419.52	0.79
18	688633	星球石墨	8,969	168,168.75	0.79
19	688129	东来技术	13,441	167,878.09	0.79
20	300816	艾可蓝	7,200	167,760.00	0.79
21	688314	康拓医疗	8,882	167,159.24	0.79
22	688466	金科环境	13,981	166,653.52	0.78
23	688132	邦彦技术	9,591	166,403.85	0.78
24	301273	瑞晨环保	10,600	165,042.00	0.78
25	688148	芳源股份	39,172	164,914.12	0.78
26	688179	阿拉丁	17,040	164,776.80	0.78
27	688010	福光股份	10,566	164,512.62	0.77
28	300371	汇中股份	19,600	164,052.00	0.77
29	603330	天洋新材	34,200	163,818.00	0.77
30	688355	明志科技	12,154	163,106.68	0.77
31	688371	菲沃泰	16,134	161,985.36	0.76
32	300179	四方达	24,400	161,284.00	0.76
33	688257	新锐股份	10,478	160,627.74	0.76
34	688162	巨一科技	8,240	160,515.20	0.76
35	605166	聚合顺	15,300	160,497.00	0.76
36	688468	科美诊断	25,259	159,889.47	0.75
37	688600	皖仪科技	11,935	159,570.95	0.75

38	688395	正弦电气	11,187	159,414.75	0.75
39	688323	瑞华泰	15,737	158,471.59	0.75
40	603115	海星股份	15,204	158,121.60	0.74
41	688178	万德斯	15,331	158,062.61	0.74
42	688560	明冠新材	14,773	157,332.45	0.74
43	688448	磁谷科技	8,329	157,251.52	0.74
44	688496	清越科技	16,855	155,740.20	0.73
45	688096	京源环保	30,661	154,838.05	0.73
46	688659	元琛科技	25,770	154,620.00	0.73
47	688669	聚石化学	13,615	154,121.80	0.73
48	688350	富淼科技	13,394	152,825.54	0.72
49	688208	道通科技	6,314	152,419.96	0.72
50	688335	复洁环保	18,608	151,655.20	0.71
51	300980	祥源新材	9,600	151,296.00	0.71
52	603579	荣泰健康	9,750	150,735.00	0.71
53	300848	美瑞新材	7,400	121,656.00	0.57
54	688100	威胜信息	3,122	119,104.30	0.56
55	688209	英集芯	9,376	116,356.16	0.55
56	603360	百傲化学	9,800	115,150.00	0.54
57	002214	大立科技	10,100	113,928.00	0.54
58	688589	力合微	4,452	112,234.92	0.53
59	300382	斯莱克	18,800	111,108.00	0.52
60	688277	天智航	14,319	110,829.06	0.52
61	688319	欧林生物	12,216	109,333.20	0.51
62	300414	中光防雷	16,500	109,065.00	0.51
63	603040	新坐标	5,400	107,622.00	0.51
64	002971	和远气体	4,300	106,554.00	0.50
65	688155	先惠技术	2,681	106,006.74	0.50
66	688768	容知日新	4,504	105,438.64	0.50
67	002833	弘亚数控	5,700	103,968.00	0.49
68	688320	禾川科技	4,231	103,828.74	0.49
69	688330	宏力达	5,088	103,744.32	0.49
70	605183	确成股份	6,700	103,582.00	0.49
71	688011	新光光电	6,817	103,277.55	0.49
72	603681	永冠新材	8,100	103,275.00	0.49
73	300515	三德科技	10,400	102,648.00	0.48
74	301010	晶雪节能	8,900	102,439.00	0.48
75	688085	三友医疗	6,044	102,143.60	0.48
76	603938	三孚股份	8,640	101,520.00	0.48
77	688219	会通股份	13,057	101,452.89	0.48
78	688046	药康生物	9,918	101,361.96	0.48
79	603192	汇得科技	7,500	100,725.00	0.47
80	605016	百龙创园	4,940	100,627.80	0.47

81	688328	深科达	7,046	100,264.58	0.47
82	603041	美思德	10,000	100,000.00	0.47
83	688435	英方软件	3,979	99,315.84	0.47
84	002996	顺博合金	16,900	98,865.00	0.47
85	688273	麦澜德	4,975	98,505.00	0.46
86	002860	星帅尔	12,000	98,280.00	0.46
87	002825	纳尔股份	15,700	97,811.00	0.46
88	688186	广大特材	10,040	97,689.20	0.46
89	688571	杭华股份	18,383	97,246.07	0.46
90	300190	维尔利	35,300	97,075.00	0.46
91	300385	雪浪环境	28,700	96,719.00	0.46
92	300853	申昊科技	6,600	95,964.00	0.45
93	688685	迈信林	3,903	95,428.35	0.45
94	688108	赛诺医疗	10,255	91,679.70	0.43
95	688156	路德环境	6,889	91,141.47	0.43
96	688071	华依科技	4,191	90,818.97	0.43
97	300993	玉马遮阳	9,900	88,506.00	0.42
98	688045	必易微	2,707	81,399.49	0.38
99	688107	安路科技	3,184	80,937.28	0.38
100	688798	艾为电子	1,334	75,531.08	0.36
101	688157	松井股份	2,188	75,267.20	0.35
102	688060	云涌科技	2,328	74,589.12	0.35
103	688381	帝奥微	3,736	72,777.28	0.34
104	688127	蓝特光学	3,927	72,217.53	0.34
105	300065	海兰信	10,900	72,049.00	0.34
106	605358	立昂微	3,100	71,734.00	0.34
107	601702	华峰铝业	3,900	71,214.00	0.34
108	603678	火炬电子	2,800	69,132.00	0.33
109	603826	坤彩科技	2,380	68,948.60	0.32
110	300493	润欣科技	8,500	68,765.00	0.32
111	688478	晶升股份	2,316	67,441.92	0.32
112	002979	雷赛智能	3,600	65,520.00	0.31
113	688489	三未信安	2,443	65,081.52	0.31
114	605389	长龄液压	3,100	65,069.00	0.31
115	688150	莱特光电	3,341	64,815.40	0.31
116	688800	瑞可达	2,305	64,724.40	0.30
117	688510	航亚科技	3,508	64,582.28	0.30
118	688110	东芯股份	3,345	63,789.15	0.30
119	688722	同益中	5,685	63,615.15	0.30
120	688069	德林海	4,697	63,127.68	0.30
121	688195	腾景科技	2,561	62,770.11	0.30
122	002658	雪迪龙	12,200	62,586.00	0.29
123	301195	北路智控	2,100	62,454.00	0.29

124	688233	神工股份	3,221	62,068.67	0.29
125	688022	瀚川智能	4,482	61,448.22	0.29
126	688372	伟测科技	1,556	61,197.48	0.29
127	001223	欧克科技	1,700	59,823.00	0.28
128	688778	厦钨新能	1,913	59,762.12	0.28
129	688201	信安世纪	5,055	59,699.55	0.28
130	688383	新益昌	1,144	59,613.84	0.28
131	688311	盟升电子	2,908	59,584.92	0.28
132	688480	赛恩斯	2,127	59,258.22	0.28
133	002810	山东赫达	5,000	58,900.00	0.28
134	688113	联测科技	2,076	58,896.12	0.28
135	688112	鼎阳科技	2,179	58,811.21	0.28
136	688353	华盛锂电	3,379	58,659.44	0.28
137	002838	道恩股份	6,400	57,984.00	0.27
138	603489	八方股份	2,100	56,658.00	0.27
139	688184	帕瓦股份	4,635	56,407.95	0.27
140	603185	弘元绿能	3,300	56,397.00	0.27
141	688236	春立医疗	3,961	56,166.98	0.26
142	688059	华锐精密	1,220	55,363.60	0.26
143	603728	鸣志电器	1,300	52,299.00	0.25
144	002332	仙琚制药	3,700	42,217.00	0.20
145	002567	唐人神	5,000	26,800.00	0.13
146	601991	大唐发电	8,800	26,488.00	0.12
147	600219	南山铝业	6,700	25,527.00	0.12
148	002340	格林美	4,000	25,480.00	0.12
149	300045	华力创通	1,400	24,710.00	0.12
150	002149	西部材料	1,700	23,732.00	0.11
151	603328	依顿电子	3,000	23,580.00	0.11
152	601369	陕鼓动力	2,900	23,258.00	0.11
153	688365	光云科技	3,749	22,568.98	0.11
154	002139	拓邦股份	2,100	22,302.00	0.11
155	002948	青岛银行	6,600	22,242.00	0.10
156	601801	皖新传媒	3,200	22,176.00	0.10
157	600125	铁龙物流	3,700	22,089.00	0.10
158	002765	蓝黛科技	4,600	21,620.00	0.10
159	002852	道道全	3,000	21,600.00	0.10
160	600184	光电股份	2,500	21,275.00	0.10
161	600710	苏美达	2,600	21,190.00	0.10
162	600033	福建高速	6,300	21,105.00	0.10
163	002322	理工能科	1,300	20,826.00	0.10
164	300645	正元智慧	1,600	20,208.00	0.10
165	002454	松芝股份	3,600	20,124.00	0.09
166	300893	松原股份	700	19,999.00	0.09

167	600879	航天电子	2,500	19,425.00	0.09
168	603889	新澳股份	2,500	19,350.00	0.09
169	000030	富奥股份	3,900	19,149.00	0.09
170	600548	深高速	1,800	19,134.00	0.09
171	300565	科信技术	1,900	19,095.00	0.09
172	003006	百亚股份	800	18,960.00	0.09
173	600496	精工钢构	7,400	18,944.00	0.09
174	002063	远光软件	3,600	18,864.00	0.09
175	002003	伟星股份	1,500	18,825.00	0.09
176	600993	马应龙	700	18,669.00	0.09
177	688373	盟科药业	4,267	18,561.45	0.09
178	600757	长江传媒	2,300	18,538.00	0.09
179	002653	海思科	600	18,420.00	0.09
180	301051	信濠光电	700	18,361.00	0.09
181	688166	博瑞医药	522	18,270.00	0.09
182	002267	陕天然气	2,400	18,144.00	0.09
183	600908	无锡银行	3,400	18,088.00	0.09
184	605208	永茂泰	2,900	18,067.00	0.09
185	603277	银都股份	600	18,024.00	0.08
186	000731	四川美丰	2,700	17,901.00	0.08
187	002973	侨银股份	2,000	17,880.00	0.08
188	688173	希荻微	1,619	17,857.57	0.08
189	300702	天宇股份	1,000	17,830.00	0.08
190	601827	三峰环境	2,100	17,829.00	0.08
191	603323	苏农银行	3,700	17,797.00	0.08
192	600320	振华重工	5,200	17,784.00	0.08
193	002782	可立克	1,600	17,728.00	0.08
194	002807	江阴银行	4,700	17,719.00	0.08
195	601339	百隆东方	3,400	17,714.00	0.08
196	001328	登康口腔	700	17,710.00	0.08
197	000650	仁和药业	3,000	17,700.00	0.08
198	002839	张家港行	4,400	17,688.00	0.08
199	605005	合兴股份	1,100	17,556.00	0.08
200	002498	汉缆股份	5,300	17,437.00	0.08
201	002026	山东威达	2,100	17,430.00	0.08
202	601579	会稽山	1,700	17,408.00	0.08
203	600790	轻纺城	5,400	17,388.00	0.08
204	600787	中储股份	3,600	17,316.00	0.08
205	002885	京泉华	1,600	17,248.00	0.08
206	603759	海天股份	2,900	17,197.00	0.08
207	600458	时代新材	1,700	17,170.00	0.08
208	600997	开滦股份	2,500	17,150.00	0.08
209	002398	垒知集团	4,600	17,112.00	0.08

210	603727	博迈科	1,300	17,108.00	0.08
211	603229	奥翔药业	1,700	17,085.00	0.08
212	002140	东华科技	2,200	17,050.00	0.08
213	002545	东方铁塔	2,500	17,025.00	0.08
214	601528	瑞丰银行	3,600	16,992.00	0.08
215	600508	上海能源	1,200	16,980.00	0.08
216	300681	英搏尔	1,300	16,952.00	0.08
217	002034	旺能环境	1,300	16,913.00	0.08
218	002768	国恩股份	900	16,830.00	0.08
219	002416	爱施德	1,900	16,815.00	0.08
220	601811	新华文轩	1,200	16,812.00	0.08
221	600429	三元股份	4,500	16,785.00	0.08
222	600391	航发科技	1,100	16,775.00	0.08
223	601512	中新集团	2,200	16,764.00	0.08
224	002441	众业达	2,200	16,676.00	0.08
225	002697	红旗连锁	3,600	16,668.00	0.08
226	002664	信质集团	1,400	16,660.00	0.08
227	300978	东箭科技	1,800	16,614.00	0.08
228	600967	内蒙一机	2,300	16,560.00	0.08
229	002286	保龄宝	3,000	16,530.00	0.08
230	000848	承德露露	2,100	16,506.00	0.08
230	301102	兆讯传媒	1,400	16,506.00	0.08
231	605133	嵘泰股份	900	16,497.00	0.08
232	600452	涪陵电力	1,300	16,471.00	0.08
233	603609	禾丰股份	2,500	16,350.00	0.08
234	002291	遥望科技	3,800	16,340.00	0.08
235	002688	金河生物	4,500	16,335.00	0.08
235	603359	东珠生态	4,500	16,335.00	0.08
236	688176	亚虹医药	3,185	16,275.35	0.08
237	600479	千金药业	1,600	16,272.00	0.08
238	002837	英维克	760	16,256.40	0.08
239	002573	清新环境	4,200	16,254.00	0.08
240	300986	志特新材	2,400	16,248.00	0.08
241	300055	万邦达	4,000	16,200.00	0.08
242	603181	皇马科技	1,800	16,182.00	0.08
243	600704	物产中大	3,700	16,058.00	0.08
244	600126	杭钢股份	3,900	16,029.00	0.08
245	601566	九牧王	1,900	15,998.00	0.08
246	688418	震有科技	932	15,965.16	0.08
247	300498	温氏股份	800	15,856.00	0.07
248	002556	辉隆股份	3,800	15,846.00	0.07
249	605068	明新旭腾	1,200	15,816.00	0.07
250	603630	拉芳家化	1,500	15,765.00	0.07

251	300384	三联虹普	1,200	15,744.00	0.07
252	603811	诚意药业	2,500	15,625.00	0.07
253	603515	欧普照明	900	15,606.00	0.07
254	603008	喜临门	900	15,597.00	0.07
255	600795	国电电力	2,600	15,574.00	0.07
256	002532	天山铝业	1,900	15,409.00	0.07
257	605222	起帆电缆	1,000	15,340.00	0.07
258	002100	天康生物	2,200	15,246.00	0.07
259	600968	海油发展	3,700	15,244.00	0.07
260	605099	共创草坪	800	15,128.00	0.07
261	002919	名臣健康	1,300	15,093.00	0.07
262	688225	亚信安全	1,272	14,411.76	0.07
263	688508	芯朋微	396	14,402.52	0.07
264	300871	回盛生物	1,500	14,310.00	0.07
265	002588	史丹利	1,900	14,307.00	0.07
266	002737	葵花药业	600	14,028.00	0.07
267	300299	富春股份	4,000	13,880.00	0.07
268	600201	生物股份	1,900	13,699.00	0.06
269	688518	联赢激光	785	13,109.50	0.06
270	600502	安徽建工	3,000	12,900.00	0.06
271	300263	隆华科技	2,300	12,880.00	0.06
272	000898	鞍钢股份	5,900	12,508.00	0.06
273	688106	金宏气体	712	12,474.24	0.06
274	002384	东山精密	600	12,420.00	0.06
275	002518	科士达	700	12,390.00	0.06
276	002444	巨星科技	500	12,350.00	0.06
277	688049	炬芯科技	516	11,413.92	0.05
278	002600	领益智造	1,600	11,392.00	0.05
279	600028	中国石化	1,800	11,376.00	0.05
280	600271	航天信息	1,500	11,040.00	0.05
281	301257	普蕊斯	390	11,017.50	0.05
282	688266	泽璟制药	200	10,844.00	0.05
283	600195	中牧股份	1,400	10,486.00	0.05
284	002649	博彦科技	1,300	10,348.00	0.05
285	000823	超声电子	1,200	10,212.00	0.05
286	300253	卫宁健康	1,700	10,030.00	0.05
287	600399	抚顺特钢	1,700	9,571.00	0.05
288	688006	杭可科技	546	9,527.70	0.04
289	000498	山东路桥	1,800	9,414.00	0.04
290	688158	优刻得	906	9,268.38	0.04
291	000090	天健集团	2,300	9,246.00	0.04
292	000021	深科技	600	9,072.00	0.04
293	600516	方大炭素	2,100	9,051.00	0.04

294	300457	赢合科技	500	8,915.00	0.04
295	002402	和而泰	800	8,568.00	0.04
296	600820	隧道股份	1,300	8,489.00	0.04
297	300319	麦捷科技	900	8,397.00	0.04
298	002334	英威腾	1,400	8,372.00	0.04
299	002152	广电运通	800	8,368.00	0.04
300	300232	洲明科技	1,600	8,352.00	0.04
300	600237	铜峰电子	1,600	8,352.00	0.04
301	601138	工业富联	300	8,220.00	0.04
302	688185	康希诺	200	8,218.00	0.04
303	002081	金螳螂	2,700	8,181.00	0.04
304	600928	西安银行	2,500	8,175.00	0.04
305	300378	鼎捷软件	500	8,135.00	0.04
306	300213	佳讯飞鸿	1,400	7,980.00	0.04
307	600633	浙数文化	900	7,929.00	0.04
308	000810	创维数字	900	7,722.00	0.04
309	600029	南方航空	1,300	7,657.00	0.04
310	600623	华谊集团	1,300	7,514.00	0.04
311	002815	崇达技术	800	7,504.00	0.04
312	002284	亚太股份	1,100	7,436.00	0.04
313	002446	盛路通信	1,300	7,345.00	0.03
314	601228	广州港	2,400	7,320.00	0.03
315	300379	东方通	900	7,272.00	0.03
316	300388	节能国祯	1,300	7,202.00	0.03
317	600664	哈药股份	2,700	7,128.00	0.03
318	601636	旗滨集团	1,100	7,095.00	0.03
319	603896	寿仙谷	300	7,041.00	0.03
320	002705	新宝股份	500	7,035.00	0.03
321	300566	激智科技	500	6,995.00	0.03
322	603393	新天然气	200	6,948.00	0.03
323	600556	天下秀	1,900	6,916.00	0.03
324	003012	东鹏控股	1,100	6,721.00	0.03
325	300510	金冠股份	1,900	6,650.00	0.03
326	688369	致远互联	420	6,606.60	0.03
327	300294	博雅生物	200	6,600.00	0.03
328	000761	本钢板材	2,600	6,526.00	0.03
329	300026	红日药业	2,100	6,405.00	0.03
330	600535	天士力	500	6,290.00	0.03
331	600587	新华医疗	390	6,138.60	0.03
332	002390	信邦制药	1,800	5,958.00	0.03
333	300682	朗新集团	700	5,957.00	0.03
334	301096	百诚医药	100	5,808.00	0.03
335	002385	大北农	1,500	5,775.00	0.03

336	688088	虹软科技	200	5,772.00	0.03
337	601158	重庆水务	1,200	5,760.00	0.03
338	300316	晶盛机电	200	5,746.00	0.03
339	300857	协创数据	100	5,700.00	0.03
340	000591	太阳能	1,200	5,652.00	0.03
341	300769	德方纳米	200	5,640.00	0.03
342	605333	沪光股份	200	5,570.00	0.03
343	600059	古越龙山	700	5,558.00	0.03
344	300607	拓斯达	400	5,448.00	0.03
345	000155	川能动力	500	5,385.00	0.03
346	603105	芯能科技	600	5,280.00	0.02
347	002439	启明星辰	300	5,178.00	0.02
348	002153	石基信息	900	5,157.00	0.02
349	300638	广和通	300	5,130.00	0.02
350	688687	凯因科技	200	5,102.00	0.02
351	600731	湖南海利	1,100	5,082.00	0.02
352	300883	龙利得	1,200	5,076.00	0.02
353	300366	创意信息	700	5,068.00	0.02
354	002158	汉钟精机	300	5,016.00	0.02
354	601222	林洋能源	800	5,016.00	0.02
355	300217	东方电热	1,300	4,901.00	0.02
356	603258	电魂网络	300	4,845.00	0.02
357	002876	三利谱	200	4,824.00	0.02
358	603043	广州酒家	300	4,791.00	0.02
359	002060	广东建工	1,400	4,788.00	0.02
360	300666	江丰电子	100	4,756.00	0.02
361	688239	航宇科技	135	4,698.00	0.02
362	600859	王府井	400	4,696.00	0.02
363	603906	龙蟠科技	600	4,674.00	0.02
364	000503	国新健康	700	4,669.00	0.02
365	600782	新钢股份	1,400	4,648.00	0.02
366	002372	伟星新材	300	4,626.00	0.02
367	600996	贵广网络	600	4,608.00	0.02
368	300726	宏达电子	200	4,560.00	0.02
369	688165	埃夫特	570	4,457.40	0.02
370	601989	中国重工	900	4,437.00	0.02
371	688133	泰坦科技	280	4,418.40	0.02
372	601886	江河集团	900	4,392.00	0.02
373	002212	天融信	900	4,383.00	0.02
374	000901	航天科技	500	4,380.00	0.02
375	002641	公元股份	1,100	4,323.00	0.02
376	600025	华能水电	400	4,312.00	0.02
377	600888	新疆众和	600	4,242.00	0.02

378	002375	亚厦股份	1,300	4,225.00	0.02
379	688299	长阳科技	328	4,195.12	0.02
380	688315	诺禾致源	382	4,171.44	0.02
381	002414	高德红外	700	4,123.00	0.02
382	002549	凯美特气	800	4,088.00	0.02
383	000962	东方钨业	400	4,084.00	0.02
384	002065	东华软件	900	4,068.00	0.02
385	002240	盛新锂能	300	4,026.00	0.02
386	000402	金融街	1,700	3,995.00	0.02
387	002585	双星新材	800	3,968.00	0.02
388	300820	英杰电气	100	3,934.00	0.02
389	002434	万里扬	800	3,920.00	0.02
390	000636	风华高科	300	3,918.00	0.02
391	300373	扬杰科技	100	3,890.00	0.02
392	002120	韵达股份	500	3,870.00	0.02
393	688425	铁建重工	1,034	3,805.12	0.02
394	002056	横店东磁	300	3,741.00	0.02
395	300115	长盈精密	300	3,597.00	0.02
396	600037	歌华有线	600	3,588.00	0.02
397	688658	悦康药业	200	3,568.00	0.02
398	688321	微芯生物	200	3,520.00	0.02
399	600469	风神股份	600	3,504.00	0.02
400	603368	柳药集团	200	3,500.00	0.02
401	600008	首创环保	1,300	3,484.00	0.02
402	688690	纳微科技	200	3,474.00	0.02
403	688131	皓元医药	181	3,462.53	0.02
404	002511	中顺洁柔	500	3,460.00	0.02
405	603699	纽威股份	200	3,424.00	0.02
406	002307	北新路桥	1,200	3,420.00	0.02
407	300403	汉宇集团	500	3,415.00	0.02
408	002075	沙钢股份	900	3,393.00	0.02
409	688579	山大地纬	429	3,367.65	0.02
410	002623	亚玛顿	200	3,326.00	0.02
411	603601	再升科技	1,200	3,312.00	0.02
412	000925	众合科技	500	3,290.00	0.02
413	603948	建业股份	200	3,256.00	0.02
414	300558	贝达药业	100	3,255.00	0.02
415	002655	共达电声	300	3,240.00	0.02
416	600808	马钢股份	1,600	3,232.00	0.02
417	688007	光峰科技	200	3,220.00	0.02
418	000852	石化机械	600	3,216.00	0.02
419	300151	昌红科技	200	3,164.00	0.01
420	002538	司尔特	700	3,136.00	0.01

421	300087	荃银高科	500	3,090.00	0.01
422	603998	方盛制药	300	3,081.00	0.01
423	002387	维信诺	500	3,040.00	0.01
424	002083	孚日股份	700	2,961.00	0.01
425	601717	郑煤机	200	2,960.00	0.01
426	688252	天德钰	200	2,906.00	0.01
427	601208	东材科技	400	2,904.00	0.01
428	600378	昊华科技	100	2,890.00	0.01
429	300772	运达股份	300	2,880.00	0.01
430	601975	招商南油	800	2,872.00	0.01
431	002276	万马股份	400	2,868.00	0.01
432	002539	云图控股	400	2,852.00	0.01
433	002998	优彩资源	500	2,835.00	0.01
434	603348	文灿股份	100	2,769.00	0.01
435	300821	东岳硅材	400	2,736.00	0.01
436	600562	国睿科技	200	2,732.00	0.01
437	002373	千方科技	300	2,721.00	0.01
438	601187	厦门银行	500	2,665.00	0.01
439	688089	嘉必优	200	2,648.00	0.01
440	300173	福能东方	700	2,639.00	0.01
441	603109	神驰机电	200	2,622.00	0.01
442	300826	测绘股份	200	2,616.00	0.01
443	300323	华灿光电	600	2,610.00	0.01
444	300659	中孚信息	200	2,594.00	0.01
445	002901	大博医疗	100	2,583.00	0.01
446	688590	新致软件	200	2,580.00	0.01
447	600327	大东方	800	2,560.00	0.01
448	603612	索通发展	200	2,552.00	0.01
449	600353	旭光电子	400	2,468.00	0.01
450	300258	精锻科技	300	2,439.00	0.01
451	600688	上海石化	900	2,349.00	0.01
452	300572	安车检测	200	2,324.00	0.01
453	600105	永鼎股份	600	2,232.00	0.01
454	300193	佳士科技	300	2,226.00	0.01
455	688586	江航装备	237	2,204.10	0.01
456	600032	浙江新能	300	2,184.00	0.01
457	600248	陕建股份	600	2,178.00	0.01
458	002958	青农商行	800	2,144.00	0.01
459	600909	华安证券	500	2,105.00	0.01
460	300571	平治信息	100	2,094.00	0.01
461	603966	法兰泰克	300	2,061.00	0.01
462	300369	绿盟科技	400	2,044.00	0.01
463	002683	广东宏大	100	2,013.00	0.01

464	000698	沈阳化工	600	1,824.00	0.01
465	300078	思创医惠	800	1,800.00	0.01
466	603366	日出东方	500	1,785.00	0.01
467	301377	鼎泰高科	100	1,755.00	0.01
468	601678	滨化股份	500	1,740.00	0.01
469	688362	甬矽电子	85	1,654.10	0.01
470	002698	博实股份	100	1,227.00	0.01
471	688026	洁特生物	10	99.60	0.00
472	002006	精工科技	5	67.10	0.00
473	688551	科威尔	1	31.50	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	688267	中触媒	388,644.55	1.44
2	688181	八亿时空	381,663.55	1.41
3	300508	维宏股份	372,160.00	1.38
4	603192	汇得科技	369,688.00	1.37
5	300993	玉马遮阳	369,089.00	1.36
6	688143	长盈通	341,878.70	1.26
7	688323	瑞华泰	341,730.28	1.26
8	688448	磁谷科技	335,367.26	1.24
9	002833	弘亚数控	329,220.00	1.22
10	688141	杰华特	327,489.84	1.21
11	688077	大地熊	318,621.07	1.18
12	688610	埃科光电	318,153.49	1.18
13	300980	祥源新材	313,464.00	1.16
14	688330	宏力达	311,975.84	1.15
15	688046	药康生物	311,489.97	1.15
16	301338	凯格精机	311,027.00	1.15
17	688219	会通股份	310,782.94	1.15
18	688496	清越科技	308,461.13	1.14
19	688179	阿拉丁	308,322.11	1.14
20	300484	蓝海华腾	307,827.00	1.14

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	300927	江天化学	449,572.00	1.66
2	300862	蓝盾光电	394,537.00	1.46

3	688267	中触媒	391,329.50	1.45
4	300508	维宏股份	382,548.00	1.41
5	688143	长盈通	380,789.45	1.41
6	300484	蓝海华腾	378,884.00	1.40
7	603192	汇得科技	363,126.00	1.34
8	301129	瑞纳智能	356,278.00	1.32
9	300920	润阳科技	351,168.00	1.30
10	300956	英力股份	345,096.00	1.28
11	688323	瑞华泰	343,298.22	1.27
12	300848	美瑞新材	342,784.00	1.27
13	688070	纵横股份	339,069.22	1.25
14	301338	凯格精机	324,526.00	1.20
15	688381	帝奥微	321,250.46	1.19
16	300414	中光防雷	320,933.00	1.19
17	688165	埃夫特	320,914.62	1.19
18	300758	七彩化学	319,837.00	1.18
19	603520	司太立	319,702.00	1.18
20	688141	杰华特	317,871.67	1.17

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	64,763,961.96
卖出股票收入（成交）总额	65,576,500.65

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券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	2,905.18
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,045.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,950.69

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 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	677	30,523.93	10,496,104.68	50.79	10,168,597.23	49.21
银华专精特新量化优选股票发起式 C	698	9,564.05	-	-	6,675,706.15	100.00
合计	1,375	19,883.93	10,496,104.68	38.39	16,844,303.38	61.61

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

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	36.58	10,002,000.20	36.58	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	36.58	10,002,000.20	36.58	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
本报告期期初基金份额总额	22,273,739.62	6,136,346.33
本报告期基金总申购份额	1,114,646.95	3,993,157.89
减：本报告期基金总赎回份额	2,723,684.66	3,453,798.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,664,701.91	6,675,706.15

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 (%)	
海通证券	3	23,912,673.28	18.35	17,836.07	17.09	-
中航证券	2	18,977,285.64	14.56	14,155.21	13.56	-
东吴证券	2	15,151,629.12	11.62	11,301.80	10.83	-
西部证券	2	14,331,587.04	11.00	13,556.47	12.99	-
中信证券	2	11,328,397.94	8.69	10,715.21	10.27	-
国盛证券	2	11,257,056.00	8.64	8,396.29	8.04	-
国海证券	2	9,672,591.19	7.42	9,149.43	8.77	-
浙商证券	2	9,233,129.00	7.08	6,887.84	6.60	-
国投证券	4	8,460,262.06	6.49	6,310.36	6.05	-
国泰君安	3	7,572,651.83	5.81	5,647.26	5.41	-
方正证券	2	443,199.51	0.34	419.19	0.40	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	7	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	3	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-

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(%)
海通证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-

世纪证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 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	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 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 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	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 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	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 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 季度报告提示性公告》	四大证券报	2024 年 4 月 19 日
7	《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	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2024 年 5 月 10 日

	(2024 年第 1 号)》	网站	
8	《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	2024 年 5 月 10 日
9	《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	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

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	20240101-20240630	10,002,000.20	0.00	0.00	10,002,000.20	36.58

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

2024 年 8 月 31 日