

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

2023 年 12 月 31 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 3 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。本年度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 03 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
8.6 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	66
8.7 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	67
8.8 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	67
8.9 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	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.3 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	68
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 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	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 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	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 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	28,410,085.95 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	22,273,739.62 份	6,136,346.33 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年 7 月 20 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 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	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	183,372.38	70,284.92	-1,274,066.91	-343,693.68
本期利润	1,429,867.85	319,898.13	-2,702,677.90	-699,452.54
加权平均基金份额本期利润	0.0584	0.0518	-0.0859	-0.0849
本期加权平均净值利润率	6.02%	5.34%	-8.91%	-8.80%
本期基金份额净值增长率	4.38%	4.07%	-8.66%	-8.78%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-1,037,832.81	-311,308.16	-2,500,864.39	-674,919.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0466	-0.0507	-0.0866	-0.0878
期末基金资产净值	21,235,906.81	5,825,038.17	26,379,246.57	7,010,085.69
期末基金份额净值	0.9534	0.9493	0.9134	0.9122
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-4.66%	-5.07%	-8.66%	-8.78%

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
过去三个月	1.36%	1.04%	-2.98%	0.87%	4.34%	0.17%
过去六个月	-5.44%	1.04%	-9.75%	0.87%	4.31%	0.17%
过去一年	4.38%	1.03%	-5.84%	0.83%	10.22%	0.20%
自基金合同生效起至今	-4.66%	1.06%	-14.08%	0.94%	9.42%	0.12%

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
过去三个月	1.29%	1.04%	-2.98%	0.87%	4.27%	0.17%
过去六个月	-5.58%	1.04%	-9.75%	0.87%	4.17%	0.17%
过去一年	4.07%	1.03%	-5.84%	0.83%	9.91%	0.20%
自基金合同生效起至今	-5.07%	1.06%	-14.08%	0.94%	9.01%	0.12%

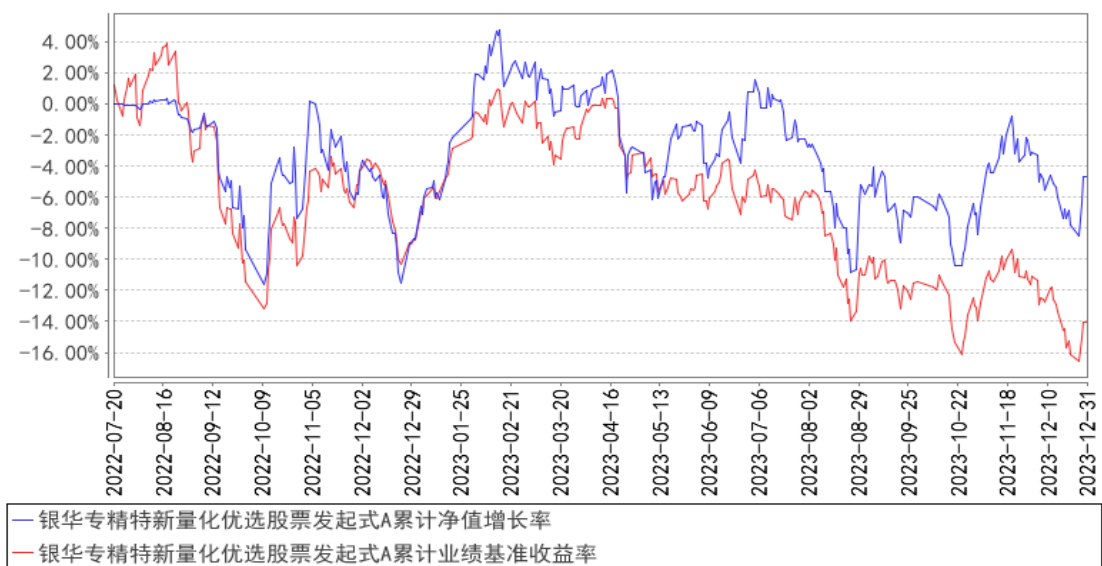
注：本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*85%+商业银行活期存款利率（税后）*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%

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。

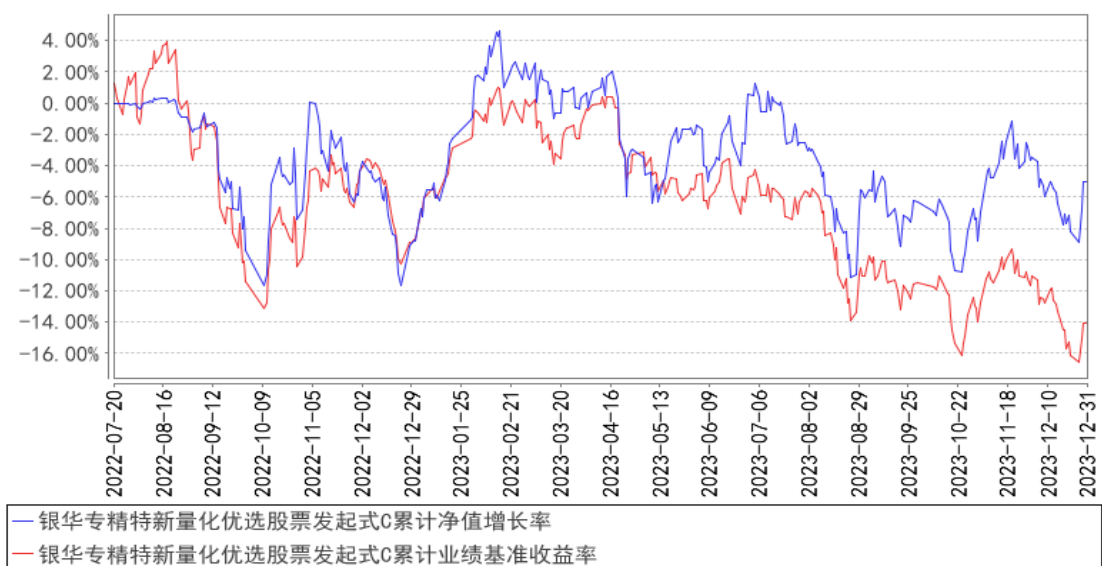
中证港股通综合指数（人民币）选取符合港股通资格的普通股作为样本股，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势，适合作为本基金港股通标的股票投资部分的业绩比较基准。

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



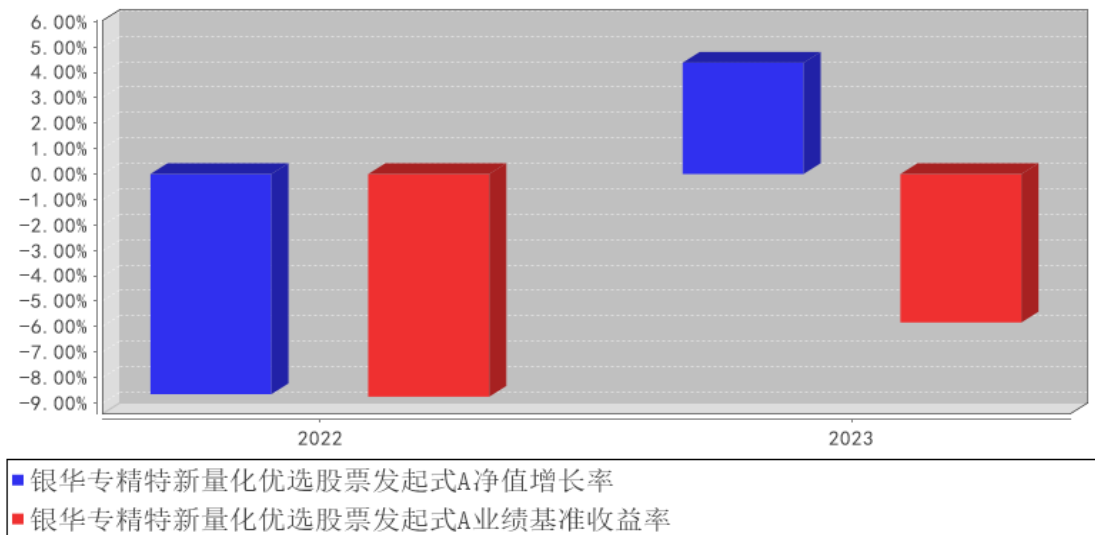
银华专精特新量化优选股票发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



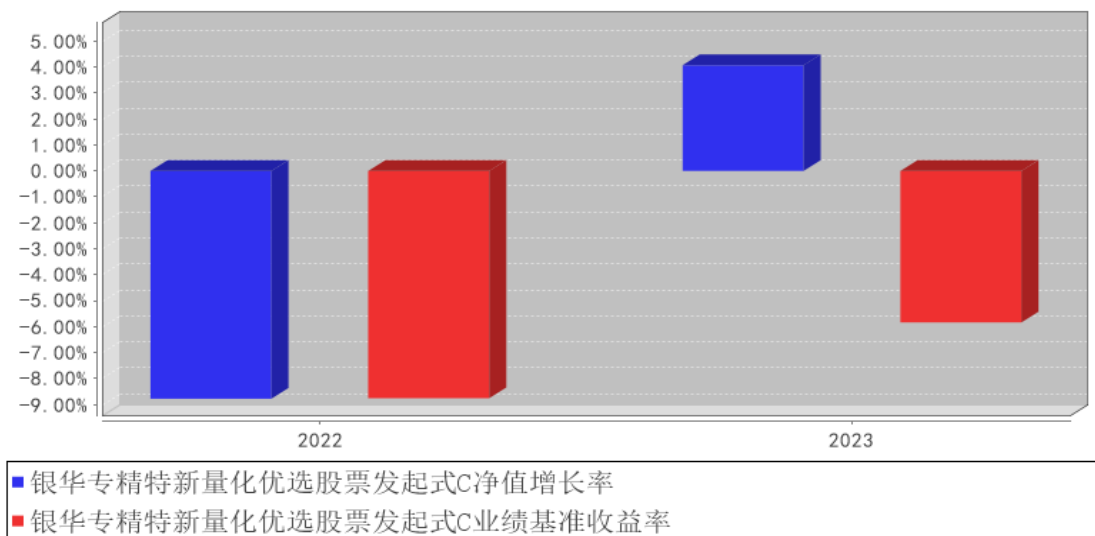
注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于“专精特新”主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约，国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金，存出保证金和应收申购款等。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



银华专精特新量化优选股票发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2022年07月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日止会计期间及2023年度未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 日，本基金管理人管理 197 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、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。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

				<p>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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定,针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动,以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则,投资管理制度和细则,集中交易管理办法,公平交易操作指引,异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制,完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估,以及履行相关的报告和信息披露义务,切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为,保护投资者合法权益。

4.3.2 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四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。

4.3.3 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12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，宏观经济逐渐从疫情中走出，从年初以来，整体呈现了从脉冲反弹到脉冲回落，最终缓慢复苏的运行特点。消费意愿和消费能力在弱复苏的通道中，商务和投资活动受到地产周期和出口需求的影响，整体复苏仍然弱势。年末，美联储加息周期接近尾声，人民币汇率相对企稳，外资持续流出的态势开始出现转变的苗头。在上述因素的作用下，2023 年 A 股市场主要相关指数表现如下，创业板下跌 19.4%，沪深 300 下跌 11.4%，中证 1000 下跌 6.3%。

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 0.9534 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.38%；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 0.9493 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.07%；业绩比较基准收益率为-5.84%。

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，在经济新旧动能更替的过程中，国内外政治经济局势推动国家向制造强国转型，专精特新“小巨人”是产业升级，高质量发展的排头兵，位于产业基础核心领域、产业链关键环节、创新能力突出、细分市场占有率高、掌握关键核心技术、质量效益好。专精特新是国家政策扶持以及市场认可度高的共振方向。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人始终坚持持有人利益优先原则，持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，根据法律法规、监管规定和业务发展的需要，持续健全合规管理及监察稽核机制，改进合规管理方式，提高合规管理能力，推进合规文化建设，提升合规管理工作的有效性。

本报告期，本基金管理人始终以法律法规、基金合同和公司制度为基础，持续健全合规制度，完善合规管理体系，提升专业能力，通过合规审核、合规检查、合规咨询等管理和防范潜在合规风险，保障各项业务规范开展。本基金管理人贯彻落实“风险为本”反洗钱理念，健全反洗钱制度建设、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，持续完善反洗钱合规和风险管理长效机制。本基金管理人综合运用合规培训、合规宣导、合规承诺、合规提示、合规谈话等多种举措厚植合规经营文化，强化人员合规意识，夯实合规文化体系基础。

本报告期内，本基金管理人根据监管规则、公司业务发展情况，建立合规风险库机制并动态更新，要求业务部门定期对照自查，加强一道防线作用，夯实合规主体责任，尽早发现和处

务中存在的合规问题和风险隐患；同时，根据年初制定监察稽核工作计划及实际情况，以日常检查、专项检查或抽查的形式开展了对投资、研究、交易、营销、宣传推介、投资者适当性、员工行为、反洗钱业务等业务环节的合规检查工作，督促责任部门落实整改，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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 12 月 31 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遵规守信、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 托管人对本年度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 2023 年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 27625 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了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“银华专精特新量化优选股票发起式”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了银华专精特新量化优选股票发起式 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于银华专精特新量化优选股票发起式,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	不适用。
其他事项	不适用。
其他信息	不适用。

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>银华专精特新量化优选股票发起式的基金管理人银华基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估银华专精特新量化优选股票发起式的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算银华专精特新量化优选股票发起式、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银华专精特新量化优选股票发起式的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对银华专精特新量化优选股票发起式持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致银华专精特新量化优选股票发起式不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出</p>

	的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈熹	崔泽宇
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2024 年 03 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,648,277.55	1,988,523.73
结算备付金		-	130,530.77
存出保证金		1,742.82	6,358.69
交易性金融资产	7.4.7.2	25,581,437.11	31,449,322.35
其中：股票投资		25,277,912.73	31,449,322.35
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,700.08	1,496.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		27,243,157.56	33,576,232.25
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		72,845.49	759.44
应付管理人报酬		27,308.26	44,253.25
应付托管费		4,551.40	7,375.56
应付销售服务费		1,414.17	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	7.4.7.9	76,093.26	132,689.82
负债合计		182,212.58	186,899.99
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	28,410,085.95	36,565,116.28
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-1,349,140.97	-3,175,784.02
净资产合计		27,060,944.98	33,389,332.26
负债和净资产总计		27,243,157.56	33,576,232.25

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 28,410,085.95 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 22,273,739.62 份，基金份额净值 0.9534 元。银华专精特新量化优选股票发起式 C 基金份额总额 6,136,346.33 份，基金份额净值 0.9493 元。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 7 月 20 日（基金 合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		2,270,987.75	-3,039,920.92
1. 利息收入		9,121.90	23,327.50
其中：存款利息收入	7.4.7.13	9,121.90	23,327.50
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）		753,756.20	-1,289,341.48
其中：股票投资收益	7.4.7.14	507,755.81	-1,303,375.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,128.82	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	244,871.57	14,034.48
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）	7.4.7.20	1,496,108.68	-1,784,369.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	12,000.97	10,462.91
减：二、营业总支出		521,221.77	362,209.52
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	408,042.17	257,844.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	68,007.01	42,974.10
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	17,982.59	10,704.86
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	27,190.00	50,685.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,749,765.98	-3,402,130.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,749,765.98	-3,402,130.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,749,765.98	-3,402,130.44

7.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31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)	-8,155,030.33	-	1,826,643.05	-6,328,387.28
(一)、综合收益总额	-	-	1,749,765.98	1,749,765.98
(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)	-8,155,030.33	-	76,877.07	-8,078,153.26
其中：1. 基金申购款	8,095,883.72	-	-123,090.14	7,972,793.58
2. 基金赎回款	-16,250,914.05	-	199,967.21	-16,050,946.84
(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	28,410,085.95	-	-1,349,140.97	27,060,944.98
项目	上年度可比期间 2022年7月20日(基金合同生效日)至2022年12月31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	-	-	-	-

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	41,114,577.73	-	-	41,114,577.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,549,461.45	-	-3,175,784.02	-7,725,245.47
(一)、综合收益总额	-	-	-3,402,130.44	-3,402,130.44
(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)	-4,549,461.45	-	226,346.42	-4,323,115.03
其中：1. 基金申购款	1,012,692.61	-	-48,900.07	963,792.54
2. 基金赎回款	-5,562,154.06	-	275,246.49	-5,286,907.57
(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	36,565,116.28	-	-3,175,784.02	33,389,332.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

本财务报表由本基金的基金管理人银华基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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》、《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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 07 月 20 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收

款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公

允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价

值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	1,648,277.55	1,988,523.73
等于：本金	1,648,113.42	1,988,305.01
加：应计利息	164.13	218.72
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	1,648,277.55	1,988,523.73

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	25,566,382.90	-	25,277,912.73	-288,470.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,404.38	303,524.38	209.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,404.38	303,524.38	209.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	25,866,293.90	3,404.38	25,581,437.11	-288,261.17

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	33,233,692.20	-	31,449,322.35	-1,784,369.85
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	33,233,692.20	-	31,449,322.35	-1,784,369.85

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.13	0.04
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	51,093.13	82,689.78
其中：交易所市场	51,093.13	82,689.78
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	25,000.00	50,000.00
合计	76,093.26	132,689.82

7.4.7.10 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12月31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	2,621,438.88	2,621,438.88
本期赎回（以“-”号填列）	-9,227,810.22	-9,227,810.22
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	22,273,739.62	22,273,739.62
-----	---------------	---------------

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 12 月 31 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	5,474,444.84	5,474,444.84
本期赎回 (以“-”号填列)	-7,023,103.83	-7,023,103.83
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	6,136,346.33	6,136,346.33

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。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,122,213.30	-1,378,651.09	-2,500,864.39
本期利润	183,372.38	1,246,495.47	1,429,867.85
本期基金份额交易产生的变动数	68,408.05	-35,244.32	33,163.73
其中：基金申购款	-41,187.45	9,794.26	-31,393.19
基金赎回款	109,595.50	-45,038.58	64,556.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-870,432.87	-167,399.94	-1,037,832.81

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
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-308,366.12	-366,553.51	-674,919.63
本期利润	70,284.92	249,613.21	319,898.13
本期基金份额交易产	-26,864.34	70,577.68	43,713.34

生的变动数			
其中：基金申购款	-114,459.15	22,762.20	-91,696.95
基金赎回款	87,594.81	47,815.48	135,410.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-264,945.54	-46,362.62	-311,308.16

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年7月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	7,250.82	22,574.07
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	1,804.67	727.57
其他	66.41	25.86
合计	9,121.90	23,327.50

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年7月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	507,755.81	-1,303,375.96
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	507,755.81	-1,303,375.96

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年7月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	168,968,747.74	54,874,552.11
减：卖出股票成本	168,007,200.13	55,983,532.35

总额		
减：交易费用	453,791.80	194,395.72
买卖股票差价收入	507,755.81	-1,303,375.96

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年7月20日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,128.82	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-
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	1,128.82	-

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年7月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	244,871.57	14,034.48
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	244,871.57	14,034.48

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年7月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日

		日
1. 交易性金融资产	1,496,108.68	-1,784,369.85
股票投资	1,495,899.68	-1,784,369.85
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	1,496,108.68	-1,784,369.85

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年7月20日（基金 合同生效日）至2022年12月 31日
基金赎回费收入	10,510.29	9,962.37
基金转换费收入	1,490.68	492.57
其他	-	7.97
合计	12,000.97	10,462.91

注：(1.) 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

(2.) 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年7月20日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
审计费用	25,000.00	50,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,190.00	685.96
合计	27,190.00	50,685.96

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
山西海鑫实业有限公司	基金管理人股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
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
银华长安资本管理(北京)有限公司	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司

注：1、根据银华基金管理股份有限公司于 2023 年 9 月 27 日发布的公告，经中国证券监督管理委员会同意，银华基金管理股份有限公司已受让银华长安资本管理（北京）有限公司持有的深圳银华永泰创新投资有限公司全部股权，深圳银华永泰创新投资有限公司已变更为银华基金管理股份有限公司的全资子公司。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年7月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	408,042.17	257,844.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	110,389.30	76,144.59
应支付基金管理人的净管理费	297,652.87	181,700.01

注：自2022年7月20日（基金合同生效日）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：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年7月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	68,007.01	42,974.10

注：自2022年7月20日（基金合同生效日）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:

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

7.4.10.2.3 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 12 月 31 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
中国工商银行	-	10,373.73	10,373.73
银华基金管理股份有限公司	-	960.59	960.59
合计	-	11,334.32	11,334.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 7 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 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
中国工商银行	-	6,349.94	6,349.94
银华基金管理股份有限公司	-	298.61	298.61
合计	-	6,648.55	6,648.55

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 类基金资产净值 0.30% 的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付给银华基金, 再由银华基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	10,002,000.20	-
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	44.90%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 7 月 20 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	10,002,000.20	-
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	34.63%	-

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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2022年7月20日（基金合同生效日）至2022 年12月31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	1,648,277.55	7,250.82	1,988,523.73	22,574.07

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总 额	备注
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大事项停牌	8.48	2024年1月10日	9.33	1,100	10,855.00	9,328.00	-
000801	四川九洲	2023年12月21日	重大事项停牌	7.70	2024年1月5日	8.47	1,100	10,024.00	8,470.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
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					
货币资金	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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末（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。

7.4.13.4.2 外汇风险

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	25,277,912.73	93.41	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	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	25,581,437.11	94.53	31,449,322.35	94.19

7.4.13.4.3.2 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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	1,172,862.97	1,026,020.70
业绩比较基准下降 5%	-1,172,862.97	-1,026,020.70	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	25,260,114.73	31,309,551.15
第二层次	321,322.38	139,771.20
第三层次	-	-
合计	25,581,437.11	31,449,322.35

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	25,277,912.73	92.79
	其中：股票	25,277,912.73	92.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	303,524.38	1.11
	其中：债券	303,524.38	1.11
	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	1,648,277.55	6.05
8	其他各项资产	13,442.90	0.05
9	合计	27,243,157.56	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	31,630.00	0.12
B	采矿业	154,412.00	0.57
C	制造业	21,728,202.28	80.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	163,809.00	0.61
E	建筑业	223,272.00	0.83
F	批发和零售业	78,892.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	83,509.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,321,887.34	4.88
J	金融业	29,670.00	0.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	41,127.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	526,199.08	1.94

N	水利、环境和公共设施管理业	792,576.03	2.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,727.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	100,000.00	0.37
S	综合	-	-
	合计	25,277,912.73	93.41

8.2.2 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。

8.3 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	300862	蓝盾光电	6,300	266,112.00	0.98
2	688127	蓝特光学	10,492	244,358.68	0.90
3	300416	苏试试验	12,470	229,073.90	0.85
4	300382	斯莱克	22,500	223,425.00	0.83
5	003025	思进智能	15,985	215,957.35	0.80
6	300900	广联航空	8,600	212,248.00	0.78
7	688323	瑞华泰	9,810	210,620.70	0.78
8	688090	瑞松科技	6,428	208,202.92	0.77
9	300035	中科电气	19,500	205,530.00	0.76
10	603109	神驰机电	12,500	205,250.00	0.76
11	002214	大立科技	17,800	204,166.00	0.75
12	688003	天准科技	5,429	203,696.08	0.75
13	603966	法兰泰克	24,900	203,682.00	0.75
14	301273	瑞晨环保	7,300	201,407.00	0.74
15	605166	聚合顺	20,300	201,376.00	0.74
16	605399	晨光新材	14,800	200,688.00	0.74
17	603115	海星股份	13,704	200,626.56	0.74
18	688625	呈和科技	5,103	200,139.66	0.74
19	300920	润阳科技	9,500	199,975.00	0.74
20	300414	中光防雷	20,700	199,341.00	0.74
21	688381	帝奥微	7,802	197,546.64	0.73
22	688069	德林海	9,935	197,507.80	0.73
23	688267	中触媒	10,234	196,697.48	0.73
24	688335	复洁环保	15,032	192,860.56	0.71
25	603579	荣泰健康	9,200	191,636.00	0.71
26	688468	科美诊断	17,745	191,468.55	0.71
27	688466	金科环境	10,685	189,658.75	0.70
28	300508	维宏股份	6,700	189,610.00	0.70

29	300848	美瑞新材	9,900	189,387.00	0.70
30	688371	菲沃泰	10,606	186,771.66	0.69
31	603520	司太立	13,200	185,856.00	0.69
32	688056	莱伯泰科	5,489	183,936.39	0.68
33	688355	明志科技	8,917	177,448.30	0.66
34	688319	欧林生物	10,815	170,877.00	0.63
35	688106	金宏气体	6,247	150,490.23	0.56
36	300927	江天化学	8,900	149,965.00	0.55
37	002675	东诚药业	8,100	148,473.00	0.55
38	300853	申昊科技	5,400	146,880.00	0.54
39	688551	科威尔	2,551	145,662.10	0.54
40	003033	征和工业	4,029	144,278.49	0.53
41	605488	福莱新材	8,300	137,780.00	0.51
42	688722	同益中	8,990	137,547.00	0.51
43	002996	顺博合金	12,500	136,500.00	0.50
44	688613	奥精医疗	6,131	136,476.06	0.50
45	688496	清越科技	6,075	136,019.25	0.50
46	603938	三孚股份	7,500	134,850.00	0.50
47	300590	移为通信	11,100	133,311.00	0.49
48	688100	威胜信息	4,601	133,060.92	0.49
49	688025	杰普特	1,435	132,809.25	0.49
50	603033	三维股份	8,400	132,804.00	0.49
51	300685	艾德生物	6,000	131,880.00	0.49
52	300817	双飞集团	7,700	130,361.00	0.48
53	002006	精工科技	8,505	129,956.40	0.48
54	603826	坤彩科技	2,200	129,866.00	0.48
55	603681	永冠新材	8,600	129,860.00	0.48
56	603185	弘元绿能	3,900	129,792.00	0.48
57	002860	星帅尔	10,000	129,500.00	0.48
58	603041	美思德	9,600	129,216.00	0.48
59	688165	埃夫特	11,249	128,913.54	0.48
60	603657	春光科技	8,000	128,720.00	0.48
61	300956	英力股份	6,900	128,547.00	0.48
62	688312	燕麦科技	6,225	128,546.25	0.48
63	300758	七彩化学	12,700	128,397.00	0.47
64	688571	杭华股份	17,125	128,095.00	0.47
65	300718	长盛轴承	6,900	127,995.00	0.47
66	605016	百龙创园	4,500	127,755.00	0.47
67	300385	雪浪环境	18,900	127,008.00	0.47
68	688510	航亚科技	7,184	126,582.08	0.47
69	688681	科汇股份	8,182	126,411.90	0.47
70	603192	汇得科技	6,400	125,760.00	0.46
71	688186	广大特材	6,958	125,383.16	0.46

72	300610	晨化股份	11,100	125,097.00	0.46
73	688398	赛特新材	3,933	124,282.80	0.46
74	300706	阿石创	4,800	124,224.00	0.46
75	300680	隆盛科技	6,600	123,420.00	0.46
76	301010	晶雪节能	6,600	123,354.00	0.46
77	688129	东来技术	7,453	123,347.15	0.46
78	688210	统联精密	4,709	123,140.35	0.46
79	688219	会通股份	11,188	122,732.36	0.45
80	300876	蒙泰高新	4,900	122,598.00	0.45
81	300631	久吾高科	4,200	122,514.00	0.45
82	688092	爱科科技	3,976	122,301.76	0.45
83	300839	博汇股份	11,940	122,146.20	0.45
84	300425	中建环能	26,000	121,680.00	0.45
85	688131	皓元医药	2,325	121,039.50	0.45
86	688096	京源环保	12,909	120,957.33	0.45
87	300190	维尔利	28,900	120,802.00	0.45
88	688350	富淼科技	7,307	120,784.71	0.45
89	688480	赛恩斯	3,109	120,380.48	0.44
90	688395	正弦电气	5,229	120,214.71	0.44
91	301129	瑞纳智能	4,500	119,835.00	0.44
92	688698	伟创电气	3,295	119,707.35	0.44
93	300930	屹通新材	5,000	119,600.00	0.44
94	688181	八亿时空	4,425	119,475.00	0.44
95	300816	艾可蓝	4,800	118,416.00	0.44
96	002838	道恩股份	9,200	117,852.00	0.44
97	688026	洁特生物	6,830	117,749.20	0.44
98	603098	森特股份	8,500	115,685.00	0.43
99	688273	麦澜德	3,441	114,619.71	0.42
100	300430	诚益通	7,800	111,462.00	0.41
101	301030	仕净科技	2,500	104,250.00	0.39
102	002324	普利特	7,900	103,885.00	0.38
103	688286	敏芯股份	1,380	98,946.00	0.37
104	002587	奥拓电子	11,400	97,698.00	0.36
105	688322	奥比中光	2,575	96,768.50	0.36
106	688519	南亚新材	3,669	94,513.44	0.35
107	002821	凯莱英	800	92,880.00	0.34
108	300079	数码视讯	15,500	88,195.00	0.33
109	300481	濮阳惠成	4,900	85,505.00	0.32
110	688368	晶丰明源	783	84,517.02	0.31
111	600459	贵研铂业	5,800	83,288.00	0.31
112	688305	科德数控	1,088	83,177.60	0.31
113	300065	海兰信	8,100	82,377.00	0.30
114	688157	松井股份	1,524	82,204.56	0.30

115	688377	迪威尔	3,048	81,747.36	0.30
116	002833	弘亚数控	4,600	81,604.00	0.30
117	688663	新风光	2,907	81,512.28	0.30
118	688391	钜泉科技	1,639	81,294.40	0.30
119	605376	博迁新材	2,800	78,960.00	0.29
120	300587	天铁股份	13,300	77,672.00	0.29
121	300777	中简科技	2,600	77,558.00	0.29
122	688080	映翰通	1,901	77,142.58	0.29
123	301195	北路智控	1,900	77,102.00	0.28
124	688282	理工导航	1,948	76,556.40	0.28
125	601908	京运通	16,700	76,319.00	0.28
126	688148	芳源股份	9,929	76,155.43	0.28
127	688369	致远互联	2,199	76,107.39	0.28
128	603893	瑞芯微	1,200	76,080.00	0.28
129	300884	狄耐克	5,800	75,864.00	0.28
130	300880	迦南智能	3,800	75,696.00	0.28
131	300357	我武生物	2,600	75,400.00	0.28
132	300286	安科瑞	2,900	75,197.00	0.28
133	688208	道通科技	3,160	75,050.00	0.28
134	688137	近岸蛋白	1,352	75,008.96	0.28
135	688633	星球石墨	2,384	74,452.32	0.28
136	688699	明微电子	1,843	74,365.05	0.27
137	002747	埃斯顿	4,000	74,360.00	0.27
138	603678	火炬电子	2,800	74,116.00	0.27
139	688138	清溢光电	3,275	74,080.50	0.27
140	002917	金奥博	7,500	74,025.00	0.27
141	300515	三德科技	6,400	73,856.00	0.27
142	688113	联测科技	1,583	73,514.52	0.27
143	300769	德方纳米	1,200	73,236.00	0.27
144	603995	甬金股份	3,800	73,074.00	0.27
145	300623	捷捷微电	4,600	73,002.00	0.27
146	688060	云涌科技	1,549	72,632.61	0.27
147	300950	德固特	4,500	72,585.00	0.27
148	688317	之江生物	3,434	72,045.32	0.27
149	688768	容知日新	1,955	71,963.55	0.27
150	688045	必易微	1,679	71,911.57	0.27
151	688353	华盛锂电	2,622	71,842.80	0.27
152	603489	八方股份	1,300	71,435.00	0.26
153	603786	科博达	1,000	71,360.00	0.26
154	688107	安路科技	1,931	71,022.18	0.26
155	688070	纵横股份	2,058	70,568.82	0.26
156	688667	菱电电控	858	70,390.32	0.26
157	688201	信安世纪	3,571	70,277.28	0.26

158	688175	高凌信息	2,513	70,188.09	0.26
159	688329	艾隆科技	2,822	70,154.92	0.26
160	301150	中一科技	2,100	69,846.00	0.26
161	688058	宝兰德	1,473	69,540.33	0.26
162	688314	康拓医疗	2,093	68,880.63	0.25
163	300909	汇创达	2,200	68,420.00	0.25
164	605358	立昂微	2,400	65,736.00	0.24
165	301080	百普赛斯	1,100	64,834.00	0.24
166	300305	裕兴股份	6,100	60,268.00	0.22
167	688685	迈信林	1,965	58,399.80	0.22
168	688188	柏楚电子	226	57,202.86	0.21
169	002983	芯瑞达	1,300	40,118.00	0.15
170	601595	上海电影	1,500	38,745.00	0.14
171	000552	甘肃能化	12,700	38,735.00	0.14
172	002215	诺普信	4,600	37,996.00	0.14
173	002588	史丹利	5,900	37,642.00	0.14
174	002332	仙琚制药	2,900	37,033.00	0.14
175	300132	青松股份	6,900	36,018.00	0.13
176	600664	哈药股份	10,300	34,505.00	0.13
177	600201	生物股份	3,200	34,464.00	0.13
178	002212	天融信	3,500	34,230.00	0.13
179	002390	信邦制药	7,500	33,300.00	0.12
180	300679	电连技术	800	33,200.00	0.12
181	601801	皖新传媒	4,700	32,665.00	0.12
182	605388	均瑶健康	2,600	32,604.00	0.12
183	000761	本钢板材	9,100	32,487.00	0.12
184	002532	天山铝业	5,300	31,853.00	0.12
185	000823	超声电子	3,300	31,581.00	0.12
186	002840	华统股份	1,500	31,185.00	0.12
187	688278	特宝生物	586	30,677.10	0.11
188	002645	华宏科技	2,700	30,510.00	0.11
189	002063	远光软件	4,800	29,664.00	0.11
190	000543	皖能电力	4,600	28,796.00	0.11
191	000655	金岭矿业	3,800	27,246.00	0.10
192	300323	华灿光电	3,700	27,084.00	0.10
193	603076	乐惠国际	1,000	26,800.00	0.10
194	603815	交建股份	3,200	26,752.00	0.10
195	002449	国星光电	2,800	26,516.00	0.10
196	002174	游族网络	2,300	26,358.00	0.10
197	000968	蓝焰控股	3,700	26,307.00	0.10
197	300893	松原股份	900	26,307.00	0.10
198	605060	联德股份	1,400	26,180.00	0.10
199	603556	海兴电力	900	26,127.00	0.10

200	000901	航天科技	2,800	26,096.00	0.10
201	603688	石英股份	300	26,064.00	0.10
202	002735	王子新材	2,000	26,000.00	0.10
203	000778	新兴铸管	6,800	25,976.00	0.10
204	002318	久立特材	1,300	25,844.00	0.10
205	600535	天士力	1,500	25,530.00	0.09
206	300232	洲明科技	2,900	25,520.00	0.09
207	300752	隆利科技	1,400	25,438.00	0.09
208	603992	松霖科技	1,400	25,396.00	0.09
209	300686	智动力	2,400	25,392.00	0.09
210	600312	平高电气	2,000	25,380.00	0.09
211	002832	比音勒芬	800	25,360.00	0.09
212	600552	凯盛科技	1,900	25,327.00	0.09
213	300673	佩蒂股份	1,900	25,270.00	0.09
214	000650	仁和药业	3,800	25,194.00	0.09
215	300829	金丹科技	1,200	25,056.00	0.09
216	600135	乐凯胶片	3,100	25,017.00	0.09
217	600727	鲁北化工	3,800	25,004.00	0.09
218	300994	久祺股份	1,700	24,990.00	0.09
219	002003	伟星股份	2,300	24,955.00	0.09
220	301102	兆讯传媒	1,300	24,882.00	0.09
221	300193	佳士科技	3,200	24,864.00	0.09
222	603010	万盛股份	2,300	24,817.00	0.09
223	605366	宏柏新材	3,000	24,810.00	0.09
224	600967	内蒙一机	3,000	24,780.00	0.09
225	300415	伊之密	1,400	24,682.00	0.09
226	300871	回盛生物	1,700	24,582.00	0.09
227	301017	漱玉平民	1,200	24,516.00	0.09
228	002635	安洁科技	1,500	24,495.00	0.09
229	000698	沈阳化工	5,800	24,476.00	0.09
230	002111	威海广泰	2,700	24,462.00	0.09
231	002196	方正电机	3,400	24,412.00	0.09
232	600755	厦门国贸	3,500	24,395.00	0.09
233	002544	普天科技	1,200	24,384.00	0.09
234	002956	西麦食品	1,700	24,361.00	0.09
235	300891	惠云钛业	2,500	24,250.00	0.09
236	300636	同和药业	2,300	24,242.00	0.09
237	002088	鲁阳节能	1,700	24,225.00	0.09
238	002035	华帝股份	3,900	24,219.00	0.09
239	002274	华昌化工	3,200	24,160.00	0.09
240	001201	东瑞股份	1,000	24,140.00	0.09
241	603277	银都股份	900	24,138.00	0.09
242	002543	万和电气	2,700	24,084.00	0.09

243	002695	煌上煌	2,300	24,081.00	0.09
244	603601	再升科技	5,600	24,080.00	0.09
245	600691	阳煤化工	7,500	24,075.00	0.09
246	603181	皇马科技	2,200	24,046.00	0.09
247	002454	松芝股份	3,200	24,032.00	0.09
248	000910	大亚圣象	3,000	24,000.00	0.09
249	002283	天润工业	4,100	23,985.00	0.09
250	000726	鲁泰 A	3,700	23,976.00	0.09
251	600939	重庆建工	7,300	23,944.00	0.09
252	002479	富春环保	5,000	23,850.00	0.09
253	600810	神马股份	3,200	23,808.00	0.09
254	600496	精工钢构	7,800	23,790.00	0.09
255	600461	洪城环境	2,600	23,764.00	0.09
256	603818	曲美家居	4,400	23,760.00	0.09
257	002891	中宠股份	900	23,715.00	0.09
258	002083	孚日股份	4,700	23,688.00	0.09
259	603989	艾华集团	1,100	23,672.00	0.09
260	300453	三鑫医疗	3,100	23,653.00	0.09
261	600987	航民股份	2,700	23,652.00	0.09
262	600429	三元股份	5,300	23,638.00	0.09
263	600966	博汇纸业	3,800	23,598.00	0.09
264	688669	聚石化学	1,258	23,574.92	0.09
265	000407	胜利股份	6,500	23,530.00	0.09
266	603113	金能科技	2,900	23,403.00	0.09
267	300137	先河环保	4,200	23,352.00	0.09
268	603848	好太太	1,500	23,220.00	0.09
269	600033	福建高速	7,400	22,940.00	0.08
270	603055	台华新材	1,900	22,876.00	0.08
271	603328	依顿电子	2,800	22,820.00	0.08
272	003006	百亚股份	1,500	22,740.00	0.08
272	688183	生益电子	2,000	22,740.00	0.08
273	600746	江苏索普	3,100	22,692.00	0.08
274	603823	百合花	2,300	22,632.00	0.08
275	601827	三峰环境	3,000	22,530.00	0.08
276	300639	凯普生物	2,400	22,416.00	0.08
277	600879	航天电子	2,900	22,359.00	0.08
278	300082	奥克股份	3,200	22,304.00	0.08
279	603558	健盛集团	2,300	22,287.00	0.08
280	002498	汉缆股份	5,500	22,000.00	0.08
281	002109	兴化股份	4,600	21,804.00	0.08
282	002327	富安娜	2,400	21,480.00	0.08
283	002688	金河生物	4,400	21,164.00	0.08
284	300349	金卡智能	1,700	21,114.00	0.08

285	600704	物产中大	4,700	20,821.00	0.08
286	300017	网宿科技	2,600	20,410.00	0.08
287	688262	国芯科技	692	20,303.28	0.08
288	002384	东山精密	1,100	19,998.00	0.07
289	688508	芯朋微	396	19,487.16	0.07
290	300401	花园生物	1,600	18,896.00	0.07
291	002653	海思科	800	18,520.00	0.07
292	002876	三利谱	500	18,385.00	0.07
293	002600	领益智造	2,700	18,252.00	0.07
294	002472	双环传动	700	18,214.00	0.07
295	601991	大唐发电	7,400	17,908.00	0.07
296	601528	瑞丰银行	3,600	17,820.00	0.07
297	600502	安徽建工	3,700	17,205.00	0.06
298	002649	博彦科技	1,400	17,178.00	0.06
299	300738	奥飞数据	1,600	16,944.00	0.06
300	688049	炬芯科技	430	16,370.10	0.06
301	002567	唐人神	2,100	15,750.00	0.06
302	300263	隆华科技	2,200	15,488.00	0.06
303	002020	京新药业	1,200	15,264.00	0.06
304	300299	富春股份	2,600	15,002.00	0.06
305	600795	国电电力	3,600	14,976.00	0.06
306	688185	康希诺	200	14,904.00	0.06
307	000887	中鼎股份	1,200	14,844.00	0.05
308	300459	汤姆猫	3,000	14,820.00	0.05
309	600126	杭钢股份	2,700	14,391.00	0.05
310	600968	海油发展	5,000	14,250.00	0.05
311	300041	回天新材	1,400	14,028.00	0.05
312	688099	晶晨股份	221	13,841.23	0.05
313	688798	艾为电子	200	13,806.00	0.05
314	601898	中煤能源	1,400	13,566.00	0.05
315	300682	朗新集团	800	13,112.00	0.05
316	688006	杭可科技	546	12,820.08	0.05
317	600138	中青旅	1,200	12,744.00	0.05
318	000709	河钢股份	5,900	12,567.00	0.05
319	000498	山东路桥	2,200	12,408.00	0.05
319	002081	金螳螂	3,300	12,408.00	0.05
320	600028	中国石化	2,200	12,276.00	0.05
321	600025	华能水电	1,400	12,082.00	0.04
322	002064	华峰化学	1,800	12,078.00	0.04
323	000951	中国重汽	900	12,024.00	0.04
324	300638	广和通	600	11,418.00	0.04
325	003019	宸展光电	500	11,300.00	0.04
326	002484	江海股份	700	11,242.00	0.04

327	600219	南山铝业	3,800	11,172.00	0.04
328	688248	南网科技	446	11,136.62	0.04
329	002158	汉钟精机	500	11,130.00	0.04
330	002152	广电运通	900	11,034.00	0.04
331	600012	皖通高速	1,000	11,020.00	0.04
332	603387	基蛋生物	1,000	11,000.00	0.04
333	000089	深圳机场	1,700	10,931.00	0.04
334	000811	冰轮环境	800	10,856.00	0.04
335	603236	移远通信	200	10,750.00	0.04
336	688388	嘉元科技	528	10,707.84	0.04
337	600195	中牧股份	900	10,674.00	0.04
338	600271	航天信息	1,000	10,640.00	0.04
339	300026	红日药业	2,500	10,600.00	0.04
340	002334	英威腾	1,200	10,476.00	0.04
341	002531	天顺风能	900	10,440.00	0.04
342	600446	金证股份	900	10,413.00	0.04
343	603977	国泰集团	1,000	10,400.00	0.04
344	600623	华谊集团	1,600	10,304.00	0.04
345	300447	全信股份	700	10,150.00	0.04
346	603466	风语筑	700	10,066.00	0.04
347	603063	禾望电气	400	10,000.00	0.04
348	600029	南方航空	1,700	9,792.00	0.04
349	600562	国睿科技	700	9,688.00	0.04
350	300510	金冠股份	1,600	9,552.00	0.04
351	600567	山鹰国际	4,900	9,506.00	0.04
352	300303	聚飞光电	1,600	9,488.00	0.04
353	688489	三未信安	200	9,404.00	0.03
354	601228	广州港	3,000	9,390.00	0.03
355	600580	卧龙电驱	800	9,384.00	0.03
356	601019	山东出版	1,000	9,380.00	0.03
357	601179	中国西电	1,900	9,367.00	0.03
358	000657	中钨高新	1,100	9,328.00	0.03
359	002807	江阴银行	2,600	9,230.00	0.03
360	300182	捷成股份	1,800	9,144.00	0.03
361	002131	利欧股份	4,000	9,120.00	0.03
362	603565	中谷物流	1,100	9,053.00	0.03
363	002206	海利得	1,800	9,036.00	0.03
364	603960	克来机电	600	8,922.00	0.03
365	603663	三祥新材	800	8,792.00	0.03
366	002705	新宝股份	600	8,742.00	0.03
367	688146	中船特气	256	8,706.56	0.03
368	300319	麦捷科技	900	8,676.00	0.03
369	601001	晋控煤业	700	8,631.00	0.03

370	002815	崇达技术	900	8,622.00	0.03
371	002928	华夏航空	1,200	8,568.00	0.03
372	601158	重庆水务	1,500	8,505.00	0.03
373	000801	四川九洲	1,100	8,470.00	0.03
374	000898	鞍钢股份	3,400	8,466.00	0.03
375	600059	古越龙山	900	8,370.00	0.03
376	600475	华光环能	800	8,320.00	0.03
377	000100	TCL 科技	1,900	8,170.00	0.03
378	002765	蓝黛科技	1,200	8,052.00	0.03
379	300699	光威复材	300	8,001.00	0.03
380	688596	正帆科技	200	7,926.00	0.03
381	300253	卫宁健康	1,100	7,909.00	0.03
382	002284	亚太股份	900	7,893.00	0.03
383	603043	广州酒家	400	7,812.00	0.03
384	600037	歌华有线	1,000	7,730.00	0.03
385	300388	节能国祯	1,200	7,716.00	0.03
386	601127	赛力斯	100	7,620.00	0.03
387	300511	雪榕生物	1,400	7,490.00	0.03
388	300566	激智科技	400	7,472.00	0.03
389	002397	梦洁股份	1,800	7,452.00	0.03
390	000723	美锦能源	1,100	7,326.00	0.03
391	001301	尚太科技	200	7,324.00	0.03
392	603936	博敏电子	700	7,308.00	0.03
393	300197	节能铁汉	3,500	7,245.00	0.03
394	002307	北新路桥	1,700	7,208.00	0.03
395	002990	盛视科技	200	6,906.00	0.03
396	603018	华设集团	900	6,840.00	0.03
397	300383	光环新网	700	6,804.00	0.03
398	600363	联创光电	200	6,800.00	0.03
399	600985	淮北矿业	400	6,652.00	0.02
400	002419	天虹股份	1,200	6,636.00	0.02
401	600731	湖南海利	1,000	6,570.00	0.02
402	301096	百诚医药	100	6,510.00	0.02
403	300671	富满微	200	6,466.00	0.02
404	300421	力星股份	500	6,455.00	0.02
405	603896	寿仙谷	200	6,448.00	0.02
406	601222	林洋能源	1,000	6,390.00	0.02
407	002132	恒星科技	2,000	6,260.00	0.02
408	688315	诺禾致源	265	6,185.10	0.02
409	002065	东华软件	1,000	6,170.00	0.02
410	688299	长阳科技	442	6,165.90	0.02
411	603393	新天然气	200	6,114.00	0.02
412	300493	润欣科技	700	5,957.00	0.02

413	600782	新钢股份	1,700	5,933.00	0.02
414	002436	兴森科技	400	5,892.00	0.02
415	600184	光电股份	500	5,715.00	0.02
416	688365	光云科技	504	5,488.56	0.02
417	600480	凌云股份	600	5,466.00	0.02
418	002439	启明星辰	200	5,400.00	0.02
419	688336	三生国健	235	5,289.85	0.02
420	300558	贝达药业	100	5,155.00	0.02
421	300442	润泽科技	200	5,074.00	0.02
422	600737	中粮糖业	600	4,944.00	0.02
423	300456	赛微电子	200	4,808.00	0.02
424	601369	陕鼓动力	600	4,788.00	0.02
425	603948	建业股份	200	4,548.00	0.02
426	600131	国网信通	300	4,545.00	0.02
427	601989	中国重工	1,100	4,543.00	0.02
428	000555	神州信息	400	4,516.00	0.02
429	002373	千方科技	400	4,484.00	0.02
430	603788	宁波高发	300	4,479.00	0.02
431	002434	万里扬	600	4,470.00	0.02
432	688135	利扬芯片	200	4,462.00	0.02
433	600170	上海建工	1,900	4,446.00	0.02
434	300870	欧陆通	100	4,427.00	0.02
435	600933	爱柯迪	200	4,388.00	0.02
436	603998	方盛制药	400	4,384.00	0.02
437	688382	益方生物	288	4,360.32	0.02
438	002852	道道全	400	4,328.00	0.02
439	600330	天通股份	500	4,315.00	0.02
440	300737	科顺股份	700	4,298.00	0.02
441	600821	金开新能	700	4,284.00	0.02
442	601168	西部矿业	300	4,281.00	0.02
443	300428	立中集团	200	4,224.00	0.02
444	688658	悦康药业	200	4,172.00	0.02
445	300007	汉威科技	200	4,156.00	0.02
446	300009	安科生物	400	4,088.00	0.02
447	300218	安利股份	300	4,065.00	0.02
448	300115	长盈精密	300	3,975.00	0.01
449	601717	郑煤机	300	3,795.00	0.01
450	603859	能科科技	100	3,773.00	0.01
451	601208	东材科技	300	3,714.00	0.01
452	000048	京基智农	200	3,660.00	0.01
453	002438	江苏神通	300	3,585.00	0.01
454	300578	会畅通讯	200	3,572.00	0.01
455	600588	用友网络	200	3,558.00	0.01

456	002127	南极电商	900	3,501.00	0.01
457	603105	芯能科技	300	3,474.00	0.01
458	002745	木林森	400	3,464.00	0.01
459	301358	湖南裕能	100	3,395.00	0.01
460	000528	柳 工	500	3,370.00	0.01
461	000561	烽火电子	400	3,360.00	0.01
462	600986	浙文互联	600	3,276.00	0.01
463	600248	陕建股份	800	3,216.00	0.01
464	603712	七一二	100	3,151.00	0.01
465	600469	风神股份	500	3,085.00	0.01
466	688579	山大地纬	238	3,022.60	0.01
467	300726	宏达电子	100	3,019.00	0.01
468	300768	迪普科技	200	2,956.00	0.01
469	000420	吉林化纤	1,000	2,910.00	0.01
470	002219	新里程	900	2,727.00	0.01
471	002958	青农商行	1,000	2,620.00	0.01
472	002187	广百股份	400	2,524.00	0.01
473	600395	盘江股份	400	2,468.00	0.01
474	300785	值得买	100	2,186.00	0.01
475	600060	海信视像	100	2,090.00	0.01
476	002925	盈趣科技	100	1,947.00	0.01
477	600125	铁龙物流	300	1,815.00	0.01
478	688238	和元生物	200	1,798.00	0.01
479	002698	博实股份	100	1,519.00	0.01
480	300258	精锻科技	100	1,292.00	0.00
481	603281	江瀚新材	40	1,051.60	0.00
482	300775	三角防务	37	1,032.30	0.00
483	002073	软控股份	100	657.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	688698	伟创电气	966,037.86	2.89
2	002675	东诚药业	925,889.85	2.77
3	688085	三友医疗	867,361.53	2.60
4	688323	瑞华泰	833,221.34	2.50
5	688186	广大特材	815,816.66	2.44
6	688700	东威科技	811,980.40	2.43
7	300685	艾德生物	792,321.00	2.37
8	603127	昭衍新药	779,898.00	2.34
9	603786	科博达	774,623.00	2.32
10	603995	甬金股份	768,070.00	2.30

11	688328	深科达	763,817.01	2.29
12	688201	信安世纪	750,141.06	2.25
13	300820	英杰电气	739,236.64	2.21
14	300839	博汇股份	735,009.20	2.20
15	688308	欧科亿	715,987.01	2.14
16	688800	瑞可达	715,164.43	2.14
17	688677	海泰新光	710,127.83	2.13
18	300481	濮阳惠成	697,079.00	2.09
19	688355	明志科技	687,836.42	2.06
20	688100	威胜信息	674,206.67	2.02
21	688131	皓元医药	673,696.64	2.02
22	605399	晨光新材	671,948.00	2.01

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。

8.4.2 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	605016	百龙创园	1,064,285.52	3.19
2	002675	东诚药业	1,038,740.14	3.11
3	300470	中密控股	996,779.29	2.99
4	688698	伟创电气	953,981.45	2.86
5	688800	瑞可达	922,924.61	2.76
6	300236	上海新阳	916,402.73	2.74
7	603360	百傲化学	903,226.85	2.71
8	688633	星球石墨	891,458.68	2.67
9	002833	弘亚数控	887,298.00	2.66
10	605183	确成股份	885,370.06	2.65
11	603127	昭衍新药	880,190.27	2.64
12	688037	芯源微	878,427.02	2.63
13	300430	诚益通	875,165.00	2.62
14	600459	贵研铂业	874,860.73	2.62
15	688328	深科达	865,632.84	2.59
16	688085	三友医疗	857,027.99	2.57
17	300820	英杰电气	838,540.00	2.51
18	603786	科博达	838,418.20	2.51
19	002869	金溢科技	834,885.00	2.50
20	002214	大立科技	822,874.42	2.46
21	603663	三祥新材	822,809.96	2.46
22	300839	博汇股份	807,586.20	2.42
23	688195	腾景科技	807,018.20	2.42
24	688700	东威科技	798,803.57	2.39
25	688159	有方科技	792,322.47	2.37
26	688626	翔宇医疗	781,291.13	2.34

27	300481	濮阳惠成	770,263.00	2.31
28	300416	苏试试验	766,267.97	2.29
29	603995	甬金股份	730,246.49	2.19
30	688571	杭华股份	728,829.03	2.18
31	300833	浩洋股份	712,363.10	2.13
32	603809	豪能股份	708,450.00	2.12
33	300114	中航电测	706,646.89	2.12
34	688312	燕麦科技	702,349.91	2.10
35	002983	芯瑞达	689,259.00	2.06
36	603203	快克智能	679,599.40	2.04
37	688350	富淼科技	676,140.51	2.03
38	688201	信安世纪	671,217.43	2.01
39	300685	艾德生物	670,539.00	2.01
40	301031	中熔电气	668,085.34	2.00

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 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	160,339,890.83
卖出股票收入（成交）总额	168,968,747.74

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	303,524.38	1.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	303,524.38	1.12

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019678	22 国债 13	3,000	303,524.38	1.12

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,742.82
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,700.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,442.90

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	767	29,040.08	10,496,104.68	47.12	11,777,634.94	52.88
银华专精特新量化优选股票发起式 C	744	8,247.78	-	-	6,136,346.33	100.00
合计	1,511	18,802.17	10,496,104.68	36.94	17,913,981.27	63.06

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）。

9.2 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	63.70	0.00
	银华专精特新量化优选股票发起式 C	-	-
	合计	63.70	0.00

9.3 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。

9.4 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	35.21	10,002,000.20	35.21	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	35.21	10,002,000.20	35.21	3 年

§ 10 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	28,880,110.96	7,685,005.32
本报告期基金总申购份额	2,621,438.88	5,474,444.84
减：本报告期基金总赎回份额	9,227,810.22	7,023,103.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,273,739.62	6,136,346.33

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

2023 年 9 月 5 日，本基金管理人发布关于首席信息官任职的公告，经本基金管理人董事会批准，邓列军先生自 2023 年 9 月 4 日起担任本基金管理人首席信息官职务。公司总经理王立新先生自 2023 年 9 月 4 日起不再代任首席信息官职务。

11.2.2 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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 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），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 25,000.00 元。该审计机构已经为本基金连续提供了 2 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	22.51	69,047.63	24.45	-
东吴证券	2	70,368,812.34	21.37	51,593.00	18.27	-
海通证券	3	42,386,616.05	12.87	31,605.10	11.19	-

国联证券	1	29,277,112.69	8.89	27,266.54	9.65	-
信达证券	1	27,451,601.25	8.34	25,760.46	9.12	-
瑞银证券	1	27,447,598.13	8.33	25,786.95	9.13	-
国海证券	2	23,908,902.37	7.26	22,266.52	7.88	-
国盛证券	2	14,745,105.29	4.48	10,783.43	3.82	-
东方财富	7	10,551,102.73	3.20	9,826.04	3.48	-
国泰君安	3	8,906,193.41	2.70	8,410.65	2.98	新增 2个 交易 单元
浙商证券	2	123,373.00	0.04	92.05	0.03	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	4	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
国信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	新增 1个 交易 单元
平安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-

中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	新增 1个 交易 单元
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	新增 1个 交易 单元
世纪证券	2	-	-	-	-	新增 2个 交易 单元
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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
信达证	-	-	-	-	-	-

券						
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	299,911.00	100.00	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券	-	-	-	-	-	-

英大证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中航证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	本基金管理人网站, 中	2023 年 6 月 2 日

	式证券投资基金基金产品资料概要更新》	中国证监会基金电子披露网站	
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
9	《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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 7 月 8 日
10	《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(2023 年 7 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 8 日
11	《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(2023 年 7 月修订)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 8 日
12	《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 2 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 12 日
13	《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 7 月 12 日
14	《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 2 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 7 月 19 日
15	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 7 月 19 日
16	《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》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 8 月 29 日
18	《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 3 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 10 月 24 日
19	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 10 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		或者超过 20% 的时间区间					(%)
机构	1	20230101-20231231	10,002,000.20	0.00	0.00	10,002,000.20	35.21
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日披露了《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 日起本基金管理费率调低至 1.2%，托管费率调低至 0.2%，并对本基金基金合同有关条款进行了修订。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 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
- 13.1.2 《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》
- 13.1.3 《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》
- 13.1.4 《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》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 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。

13.3 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 3 月 29 日