

银华专精特新量化优选股票型发起式证券
投资基金
2025 年年度报告

2025 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：2026 年 3 月 28 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 2026 年 03 月 26 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 2025 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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	54

8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	89
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	89
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	89
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	89
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	89
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	89
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	89
8.12 投资组合报告附注	89
§ 9 基金份额持有人信息	90
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	90
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	90
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	91
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	91
§ 10 开放式基金份额变动	91
§ 11 重大事件揭示	92
11.1 基金份额持有人大会决议	92
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	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	92
11.4 基金投资策略的改变	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	92
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	92
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	93
11.8 其他重大事件	96
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	97
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	97
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	98
§ 13 备查文件目录	98
13.1 备查文件目录	98
13.2 存放地点	98
13.3 查阅方式	98

§ 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	129,763,749.70 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	47,850,332.60 份	81,913,417.10 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金资产的比例</p>

	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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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	2025 年		2024 年		2023 年	
	银华专精特新量化优选股票发起式	银华专精特新量化优选股票发起式	银华专精特新量化优选股票发起式	银华专精特新量化优选股票发起式	银华专精特新量化优选股票发起式	银华专精特新量化优选股票发起式
	A	C	A	C	A	C
本期已实现收益	13,736,206.36	18,074,063.58	218,992.45	40,717.61	183,372.38	70,284.92
本期利润	17,734,493.76	23,969,090.43	237,921.46	198,264.00	1,429,867.85	319,898.13
加权平均基金份额本期利润	0.4837	0.4598	0.0113	0.0312	0.0584	0.0518
本期加权平均净值利润率	37.04%	33.91%	1.35%	3.74%	6.02%	5.34%
本期基金份额净值增长率	50.95%	50.50%	2.84%	2.53%	4.38%	4.07%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	16,237,389.25	26,659,202.55	-380,282.92	-148,914.61	-1,037,832.81	-311,308.16
期末可供分配基金份额利润	0.3393	0.3255	-0.0195	-0.0267	-0.0466	-0.0507
期末基金资产净值	70,823,370.84	119,989,947.87	19,124,073.09	5,428,741.03	21,235,906.81	5,825,038.17
期末基金份额净值	1.4801	1.4648	0.9805	0.9733	0.9534	0.9493
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	48.01%	46.48%	-1.95%	-2.67%	-4.66%	-5.07%

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

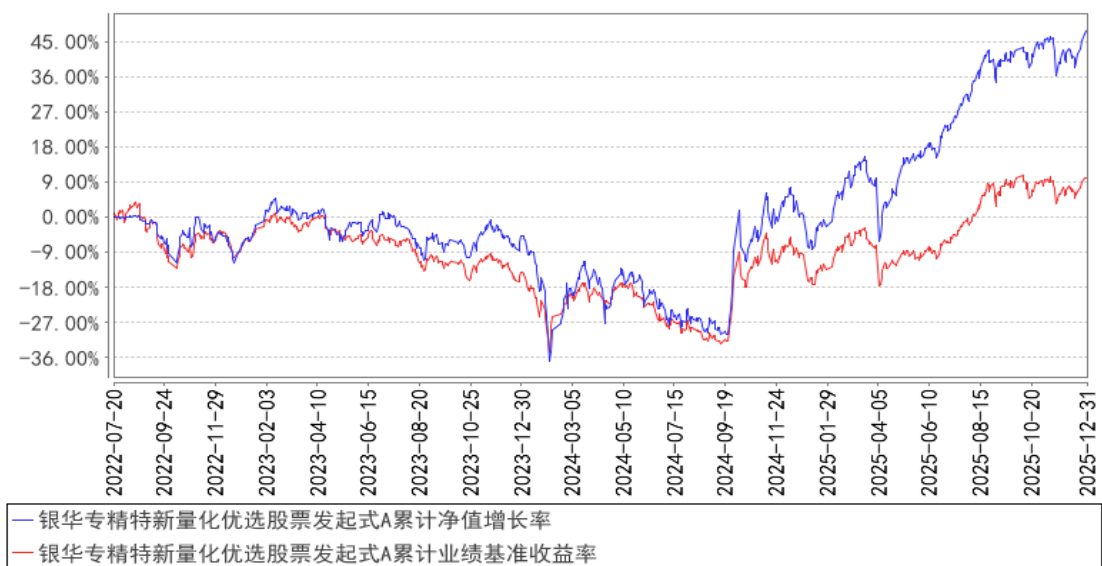
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.65%	1.03%	-0.09%	1.01%	3.74%	0.02%
过去六个月	19.98%	0.96%	16.91%	0.98%	3.07%	-0.02%
过去一年	50.95%	1.50%	24.77%	1.25%	26.18%	0.25%
过去三年	62.04%	1.83%	20.49%	1.36%	41.55%	0.47%
自基金合同生效起至今	48.01%	1.75%	9.94%	1.34%	38.07%	0.41%

银华专精特新量化优选股票发起式 C

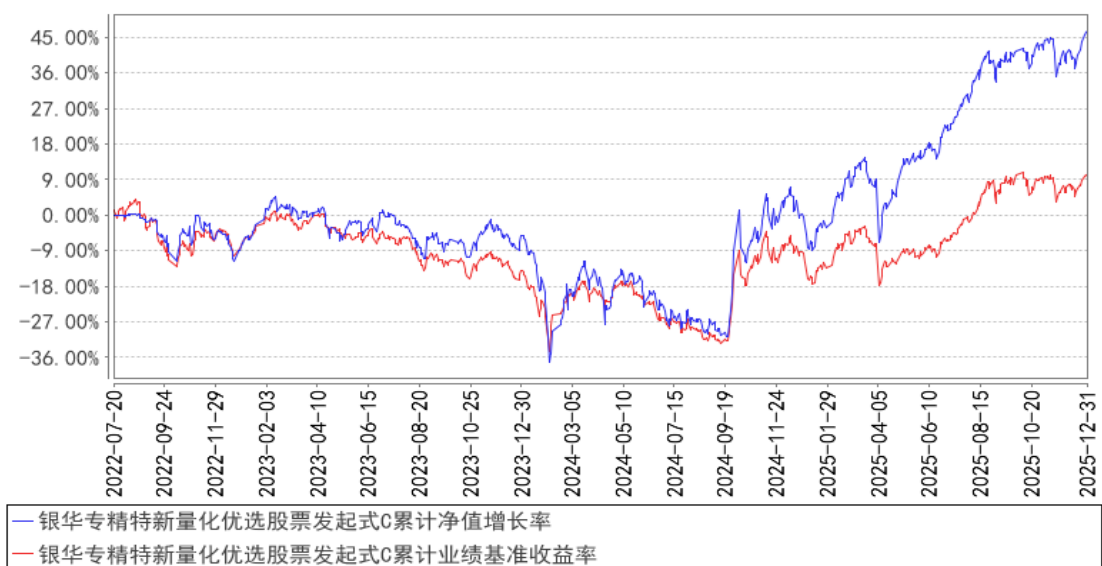
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.56%	1.03%	-0.09%	1.01%	3.65%	0.02%
过去六个月	19.80%	0.96%	16.91%	0.98%	2.89%	-0.02%
过去一年	50.50%	1.50%	24.77%	1.25%	25.73%	0.25%
过去三年	60.58%	1.83%	20.49%	1.36%	40.09%	0.47%
自基金合同生效起至今	46.48%	1.75%	9.94%	1.34%	36.54%	0.41%

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



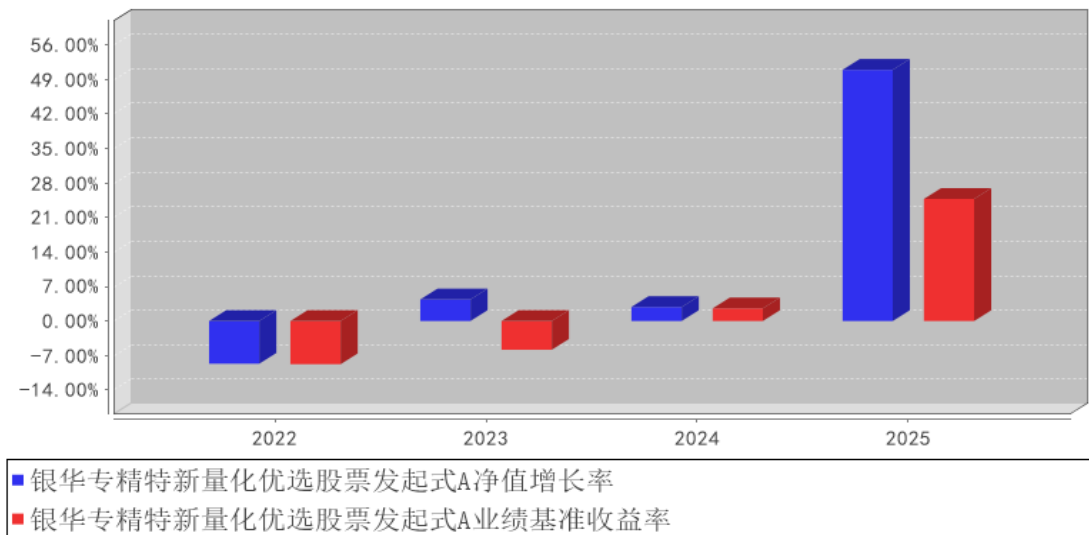
银华专精特新量化优选股票发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



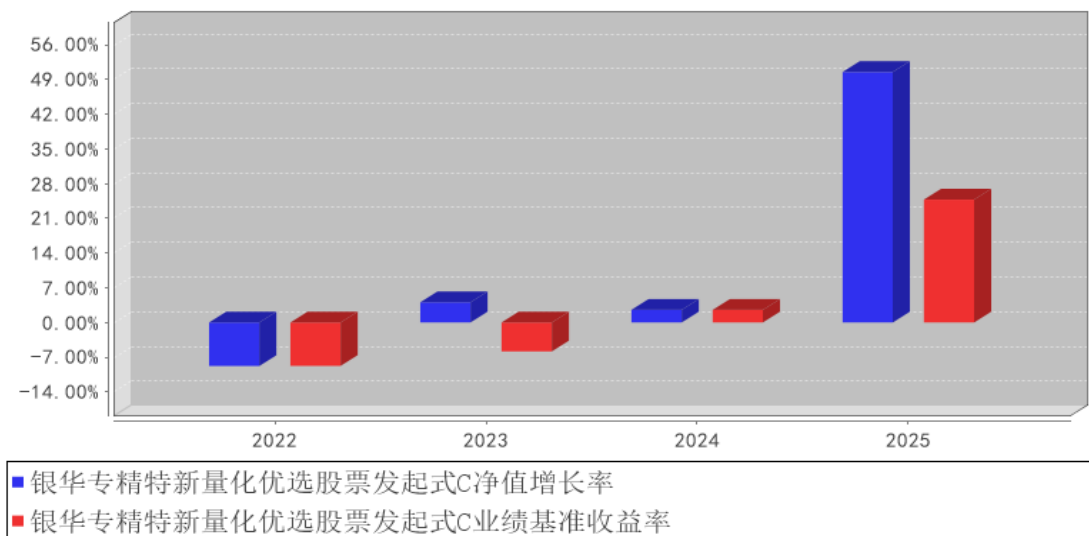
注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于“专精特新”主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约，国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金，存出保证金和应收申购款等。

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：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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

银华基金管理股份有限公司成立于 2001 年 5 月，注册资本 2.222 亿人民币，是一家全牌照、

综合型资产管理公司。公司注册地为深圳，有北京和上海两家分公司，银华资本、银华国际、银华永泰三家子公司。公司拥有企业年金基金投资管理人、合格境内机构投资者（QDII）、特定客户资产管理人、社保基金境内委托投资管理人、保险资金投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、基金投资顾问业务试点等多项业务资格。截至 2025 年底，银华基金管理公募基金 242 只，建立了覆盖权益、固收、量化、QDII、FOF、REITs 等类型的全系列产品线。

银华基金秉承“坚持做长期正确的事”的企业价值观，在业内树立了良好的品牌形象，赢得了投资者和业界的广泛认可，十次获得“金牛基金管理公司”奖。公司坚持践行企业社会责任，成立深圳市银华公益基金会，致力于改善贫困人口生活水平，推动社会教育环境的改善，促进教育公平和可持续发展；并自 2020 年起连续五年实现运营层面碳中和。

银华基金始终坚持以客户为中心，持有人利益至上，做价值投资理念的坚定追随者，不盲目追求短期收益，注重控制投资风险，以细水长流的方式积蓄力量，追求长期持续的稳健回报。

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		
杨腾先生	本基金的基金经理	2025 年 3 月 7 日	-	13.5 年	硕士学位。曾就职于信达证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。2015 年 7 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员，量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理/投资经理助理（社保、基本养老）。自 2021 年 11 月 29 日起担任银华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、银华深证 100 指数证券投资基金（LOF）、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华新能源新材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、银华中证等权重 90 指数证券投资基金（LOF）基金经理，自 2021 年 11 月 29 日至 2023 年 3 月 16 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基金经理，自 2025 年 3 月 7 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 2025 年 9 月 16 日起兼任银华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

李宜璇女士	本基金的基金经理	2022 年 7 月 20 日	2025 年 3 月 12 日	12 年	<p>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，现任量化投资部总监助理/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 日至 2025 年 5 月 29 日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</p>
-------	----------	-----------------	-----------------	------	--

					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 日至 2025 年 3 月 12 日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 日至 2025 年 9 月 16 日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，自 2025 年 4 月 25 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发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
张卓希女士	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 22 日	-	9.5 年	硕士研究生。曾就职于安永华明会计师事务所、安永（中国）企业咨询有限公司，2016 年 5 月加入银华基金，现任境外投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
郭九良先生	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 30 日	-	7 年	硕士研究生。2018 年 8 月加入银华基金管理股份有限公司，现任量化投资部基金经理助理。具有从业资格。国籍：中国。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2025 年 8 月 19 日	2025 年 10 月 22 日	12 年	大学本科。曾就职于上海携宁计算机科技有限公司、上海恒生聚源数据服务有限公司。2013 年 7 月加入银华基金。现任量化投资部基金经理。自 2025 年 12 月 5 日起担任银华中证高股息策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2026 年 2 月 10 日起兼任银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份

额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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2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

2025年国内外宏观经济运行呈现出一些新的特征。国内方面，宏观经济继续呈现整体复苏与结构调整态势，新质经济驱动力提升。在消费品国补等政策支撑下，内需消费整体平稳；房地产产业链复苏较弱。此外，AI、科技硬件、新消费等新兴行业都出现了热度持久的产品，体现出新经济的活力提升。国外方面，美联储在降息通道中继续前行，全年三次降低基准利率；而另一方面，全球主要经济体之间的关税贸易政策框架在博弈中渐进成型，不确定性有所收敛但仍存变数。在上述因素的作用下，A股市场主要指数在2025年明显上行。行业方面，有色金属、通信、电子

等行业表现领先。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华专精特新量化优选股票发起式 A 基金份额净值为 1.4801 元,本报告期基金份额净值增长率为 50.95%;截至本报告期末银华专精特新量化优选股票发起式 C 基金份额净值为 1.4648 元,本报告期基金份额净值增长率为 50.50%;业绩比较基准收益率为 24.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望新的一年,我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的波动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,新的产业链条正在逐渐取代旧产业,成为国民经济的主体支柱。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、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。

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基于风险的反洗钱理念,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,尽早发现和和业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、反洗钱等方面的合规检查工作,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 2025 年 6 月 26 日。由于本基金属于发起式基金，无需向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2025 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	容诚审字[2026]200Z1124 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>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”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于银华专精特新量化优选股票发起式，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	不适用。
其他事项	不适用。
其他信息	不适用。
管理层和治理层对财务报表的责任	<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</p>

	<p>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>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>（1）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>（2）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>（3）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>（4）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>（5）评价财务报表的总体列报、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的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈熹 陈玉珊
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
审计报告日期	2026年03月26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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	17,982,414.88	1,083,806.48
结算备付金		497,585.74	89,203.31
存出保证金		73,959.85	3,958.41
交易性金融资产	7.4.7.2	171,524,936.89	23,569,368.64
其中：股票投资		171,524,936.89	22,658,485.30
基金投资		-	-
债券投资		-	910,883.34
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		93,913.37	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,224,343.50	87,231.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		193,397,154.23	24,833,568.03
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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		1,965,726.32	210,847.32

应付管理人报酬		190,660.52	26,840.75
应付托管费		31,776.76	4,473.46
应付销售服务费		29,861.18	1,511.79
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	365,810.74	37,080.59
负债合计		2,583,835.52	280,753.91
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	129,763,749.70	25,082,011.65
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	61,049,569.01	-529,197.53
净资产合计		190,813,318.71	24,552,814.12
负债和净资产总计		193,397,154.23	24,833,568.03

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，银华专精特新量化优选股票发起式 A 基金份额净值 1.4801 元，基金份额总额 47,850,332.60 份；银华专精特新量化优选股票发起式 C 基金份额净值 1.4648 元，基金份额总额 81,913,417.10 份。银华专精特新量化优选股票发起式份额总额合计为 129,763,749.70 份。

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		43,716,200.99	779,300.93
1. 利息收入		74,175.31	6,891.81
其中：存款利息收入	7.4.7.13	74,175.31	6,891.81
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）		32,641,824.77	569,516.98
其中：股票投资收益	7.4.7.14	31,945,380.20	313,623.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-11,178.34	6,643.14

资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
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	707,622.91	249,250.07
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	9,893,314.25	176,475.40
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	1,106,886.66	26,416.74
减：二、营业总支出		2,012,616.80	343,115.47
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,404,101.88	274,605.52
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	234,017.04	45,767.64
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	208,714.11	15,853.93
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	165,783.77	6,888.38
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)		41,703,584.19	436,185.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		41,703,584.19	436,185.46
五、其他综合收益的税后净 额		-	-
六、综合收益总额		41,703,584.19	436,185.46

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益		
一、上期期末净资产	25,082,011.65	-	-529,197.53	24,552,814.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	25,082,011.65	-	-529,197.53	24,552,814.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	104,681,738.05	-	61,578,766.54	166,260,504.59
（一）、综合收益总额	-	-	41,703,584.19	41,703,584.19
（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）	104,681,738.05	-	19,875,182.35	124,556,920.40
其中：1. 基金申购款	404,564,284.18	-	123,329,118.69	527,893,402.87
2. 基金赎回款	-299,882,546.13	-	-103,453,936.34	-403,336,482.47
（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	129,763,749.70	-	61,049,569.01	190,813,318.71
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	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）	-3,328,074.30	-	819,943.44	-2,508,130.86
（一）、综合收益总额	-	-	436,185.46	436,185.46
（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）	-3,328,074.30	-	383,757.98	-2,944,316.32
其中：1. 基金申购款	11,564,240.94	-	-1,286,393.85	10,277,847.09
2. 基金赎回款	-14,892,315.24	-	1,670,151.83	-13,222,163.41
（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	25,082,011.65	-	-529,197.53	24,552,814.12

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“中国工商银行”)。

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 2026 年 3 月 26 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 2025 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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。

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商业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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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 and 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确认。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扣除按票面利率(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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	17,982,414.88	1,083,806.48
等于: 本金	17,980,264.84	1,083,713.40
加: 应计利息	2,150.04	93.08
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	17,982,414.88	1,083,806.48

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	161,743,408.41	-	171,524,936.89	9,781,528.48

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	161,743,408.41	-	171,524,936.89	9,781,528.48	
项目	上年度末 2024年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	22,755,896.07	-	22,658,485.30	-97,410.77	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	915,915.00	9,343.34	910,883.34	-14,375.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	915,915.00	9,343.34	910,883.34	-14,375.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	23,671,811.07	9,343.34	23,569,368.64	-111,785.77	

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,507.89	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	203,302.85	32,080.59
其中：交易所市场	203,302.85	32,080.59
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	5,000.00
合计	365,810.74	37,080.59

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 2025年1月1日至2025年12月31日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,504,356.01	19,504,356.01
本期申购	85,028,181.33	85,028,181.33
本期赎回（以“-”号填列）	-56,682,204.74	-56,682,204.74
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	47,850,332.60	47,850,332.60

银华专精特新量化优选股票发起式 C

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,577,655.64	5,577,655.64
本期申购	319,536,102.85	319,536,102.85
本期赎回（以“-”号填列）	-243,200,341.39	-243,200,341.39
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	81,913,417.10	81,913,417.10

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	-370,634.19	-9,648.73	-380,282.92
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-370,634.19	-9,648.73	-380,282.92
本期利润	13,736,206.36	3,998,287.40	17,734,493.76
本期基金份额交易产生的变动数	2,871,817.08	2,747,010.32	5,618,827.40
其中：基金申购款	14,862,757.56	11,694,427.91	26,557,185.47
基金赎回款	-11,990,940.48	-8,947,417.59	-20,938,358.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,237,389.25	6,735,648.99	22,973,038.24

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	-145,129.70	-3,784.91	-148,914.61
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-145,129.70	-3,784.91	-148,914.61
本期利润	18,074,063.58	5,895,026.85	23,969,090.43
本期基金份额交易产生的变动数	8,730,268.67	5,526,086.28	14,256,354.95
其中：基金申购款	52,322,802.13	44,449,131.09	96,771,933.22
基金赎回款	-43,592,533.46	-38,923,044.81	-82,515,578.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,659,202.55	11,417,328.22	38,076,530.77

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	71,276.32	5,531.66
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	1,062.03	1,314.18
其他	1,836.96	45.97
合计	74,175.31	6,891.81

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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	31,945,380.20	313,623.77
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	31,945,380.20	313,623.77

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	438,915,918.44	128,774,591.98
减：卖出股票成本总额	406,249,504.18	128,220,677.44
减：交易费用	721,034.06	240,290.77
买卖股票差价收入	31,945,380.20	313,623.77

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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	4,736.66	6,554.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-15,915.00	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	-11,178.34	6,643.14

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	914,080.00	306,540.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	915,915.00	299,911.00
减：应计利息总额	14,080.00	6,540.00
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-15,915.00	89.00

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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月

	31 日	31 日
股票投资产生的股利收益	707,622.91	249,250.07
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	707,622.91	249,250.07

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	9,893,314.25	176,475.40
股票投资	9,878,939.25	191,059.40
债券投资	14,375.00	-14,584.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	9,893,314.25	176,475.40

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,054,299.25	25,570.23
基金转换费收入	52,587.41	846.51
合计	1,106,886.66	26,416.74

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	5,000.00

信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	5,383.77	1,888.38
其他	400.00	-
合计	165,783.77	6,888.38

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”）	基金管理人的股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人的股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
山西海鑫实业有限公司	基金管理人的股东
珠海银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
珠海银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
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
银华长安资产管理(北京)有限公司	基金管理人的子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人的子公司

注：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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东北证券	26,334,723.81	2.68	-	-

西南证券	5,112,422.11	0.52	-	-
------	--------------	------	---	---

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东北证券	11,742.79	2.68	11,742.79	5.78
西南证券	2,279.75	0.52	81.03	0.04
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,404,101.88
其中：应支付销售机构的客户维护 费	380,376.96	70,520.29
应支付基金管理人的净管理费	1,023,724.92	204,085.23

注：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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	234,017.04	45,767.64

注：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 2025年1月1日至2025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
东北证券	-	5.26	5.26
银华基金	-	62,515.39	62,515.39
中国工商银行	-	22,754.47	22,754.47
合计	-	85,275.12	85,275.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
银华基金	-	801.98	801.98
中国工商银行	-	7,145.69	7,145.69
合计	-	7,947.67	7,947.67

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。

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025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	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,000.20	-
报告期内申购/ 买入总份额	-	-
报告期内因拆分 变动份额	-	-
减：报告期内赎回/ 卖出总份额	-	-
报告期末持有的 基金份额	10,002,000.20	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比例	20.90%	-

项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-
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	51.28%	-

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	17,982,414.88	71,276.32	1,083,806.48	5,531.66

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（2025 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新股流通受限	48.00	51.88	132	6,336.00	6,848.16	-
001280	中国铝业	2025年11月25日	6个月	新股流通受限	17.89	45.36	729	13,041.81	33,067.44	-
001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	42.28	56.08	59	2,494.52	3,308.72	-
001369	双欣材料	2025年12月23日	6个月	新股流通受限	6.85	12.89	287	1,965.95	3,699.43	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股流通受限	13.75	18.53	681	9,363.75	12,618.93	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301638	南	2025	6个月	新股	5.69	14.21	754	4,290.26	10,714.34	-

	网数字	年 11 月 11 日		流通受限						
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股流通受限	12.48	25.46	1,424	17,771.52	36,255.04	-
301668	昊创瑞通	2025 年 9 月 15 日	6 个月	新股流通受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	54.39	152	3,333.36	8,267.28	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30 日	6 个月	新股流通受限	46.68	55.66	48	2,240.64	2,671.68	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股流通受限	17.08	48.56	143	2,442.44	6,944.08	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	24.49	32.82	74	1,812.26	2,428.68	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	6 个月	新股流通受限	46.36	59.06	58	2,688.88	3,425.48	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股流通受限	14.99	34.87	308	4,616.92	10,739.96	-
688790	昂	2025	6 个月	新股	83.06	117.19	21	1,744.26	2,460.99	-

	瑞微	年 12 月 9 日		流通受限						
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	6 个月	新股流通受限	114.28	416.18	22	2,514.16	9,155.96	-
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股流通受限	26.68	42.25	164	4,375.52	6,929.00	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	104.66	399.31	13	1,360.58	5,191.03	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	51.66	135.56	74	3,822.84	10,031.44	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	85.09	203.31	55	4,679.95	11,182.05	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板、创业板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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 2025 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	17,982,414.88	-	-	-	17,982,414.88
结算备付金	497,585.74	-	-	-	497,585.74
存出保证金	73,959.85	-	-	-	73,959.85
交易性金融资产	-	-	-	171,524,936.89	171,524,936.89
应收申购款	-	-	-	3,224,343.50	3,224,343.50
应收清算款	-	-	-	93,913.37	93,913.37
资产总计	18,553,960.47	-	-	174,843,193.76	193,397,154.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,965,726.32	1,965,726.32

应付管理人报酬	-	-	-	190,660.52	190,660.52
应付托管费	-	-	-	31,776.76	31,776.76
应付销售服务费	-	-	-	29,861.18	29,861.18
其他负债	-	-	-	365,810.74	365,810.74
负债总计	-	-	-	2,583,835.52	2,583,835.52
利率敏感度缺口	18,553,960.47	-	-	-172,259,358.24	190,813,318.71
上年度末 2024 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	1,083,806.48	-	-	-	1,083,806.48
结算备付金	89,203.31	-	-	-	89,203.31
存出保证金	3,958.41	-	-	-	3,958.41
交易性金融资产	910,883.34	-	-	22,658,485.30	23,569,368.64
应收申购款	-	-	-	87,231.19	87,231.19
资产总计	2,087,851.54	-	-	22,745,716.49	24,833,568.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	210,847.32	210,847.32
应付管理人报酬	-	-	-	26,840.75	26,840.75
应付托管费	-	-	-	4,473.46	4,473.46
应付销售服务费	-	-	-	1,511.79	1,511.79
其他负债	-	-	-	37,080.59	37,080.59
负债总计	-	-	-	280,753.91	280,753.91
利率敏感度缺口	2,087,851.54	-	-	-22,464,962.58	24,552,814.12

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	0.00	-774.05
	-25 个基点	0.00	774.05

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 2025年12月31日		上年度末 2024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	171,524,936.89	89.89	22,658,485.30	92.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	910,883.34	3.71
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	171,524,936.89	89.89	23,569,368.64	95.99

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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月

			31 日)
	业绩比较基准上升 5%	10,817,614.76	1,246,511.16
	业绩比较基准下降 5%	-10,817,614.76	-1,246,511.16

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	171,293,119.26	22,658,485.30
第二层次	-	910,883.34
第三层次	231,817.63	-
合计	171,524,936.89	23,569,368.64

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

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	106,110.01	106,110.01
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	125,707.62	125,707.62
其中：计入损益的利得或损失	-	125,707.62	125,707.62
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	231,817.63	231,817.63
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	125,707.62	125,707.62
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	-	-

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于本报告期，本基金购买第三层次交易性金融资产及第三层次转入/转出的交易性金融资产均为限售股票投资及限售期开始/结束的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
锁定期股票	231,817.63	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	22.08%-307.91%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

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	171,524,936.89	88.69
	其中：股票	171,524,936.89	88.69
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	18,480,000.62	9.56
8	其他各项资产	3,392,216.72	1.75
9	合计	193,397,154.23	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	138,344.00	0.07
B	采矿业	117,423.44	0.06
C	制造业	150,779,982.64	79.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,039,114.00	0.54
E	建筑业	2,883,268.00	1.51
F	批发和零售业	416,506.44	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	1,971,493.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,580,944.08	3.97
J	金融业	720,817.00	0.38
K	房地产业	289,088.00	0.15
L	租赁和商务服务业	299,191.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	1,628,066.25	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	3,601,767.04	1.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	35,902.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	23,030.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	171,524,936.89	89.89

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	002324	普利特	110,700	1,770,093.00	0.93
2	002947	恒铭达	32,400	1,685,448.00	0.88
3	301007	德迈仕	41,200	1,669,424.00	0.87
4	605167	利柏特	96,000	1,577,280.00	0.83
5	301273	瑞晨环保	56,000	1,483,440.00	0.78
6	603950	长源东谷	49,200	1,424,340.00	0.75
7	301283	聚胶股份	29,700	1,419,066.00	0.74
8	603041	美思德	116,500	1,403,825.00	0.74
9	301002	崧盛股份	38,100	1,387,221.00	0.73
10	300371	汇中股份	109,400	1,375,158.00	0.72
11	603203	快克智能	37,400	1,369,214.00	0.72
12	001205	盛航股份	78,400	1,340,640.00	0.70
13	301338	凯格精机	15,100	1,330,461.00	0.70
14	603489	八方股份	42,100	1,287,418.00	0.67
15	605183	确成股份	63,400	1,262,928.00	0.66
16	001223	欧克科技	25,620	1,244,619.60	0.65
17	001306	夏厦精密	13,900	1,237,100.00	0.65
18	301280	珠城科技	22,800	1,214,328.00	0.64
19	002587	奥拓电子	177,700	1,201,252.00	0.63
20	300926	博俊科技	35,400	1,160,412.00	0.61
21	300931	通用电梯	103,600	1,146,852.00	0.60
22	002747	埃斯顿	48,100	1,139,970.00	0.60
23	603124	江南新材	14,400	1,135,728.00	0.60
24	300461	田中精机	58,500	1,116,180.00	0.58
25	603281	江瀚新材	39,900	1,107,225.00	0.58
26	605376	博迁新材	16,900	1,105,260.00	0.58
27	002810	山东赫达	72,500	1,075,175.00	0.56
28	003025	思进智能	74,600	1,072,002.00	0.56
29	603938	三孚股份	55,500	1,060,605.00	0.56
30	300976	达瑞电子	17,600	1,057,232.00	0.55
31	002545	东方铁塔	57,200	1,055,340.00	0.55
32	603286	日盈电子	15,200	1,051,232.00	0.55
33	605258	协和电子	33,600	1,050,672.00	0.55
34	603115	海星股份	56,100	1,049,631.00	0.55
35	300916	朗特智能	31,800	1,042,404.00	0.55
36	001332	锡装股份	18,400	1,033,896.00	0.54
37	002054	德美化工	140,000	1,033,200.00	0.54
38	603701	德宏股份	50,600	1,020,096.00	0.53
39	002829	星网宇达	32,200	1,011,724.00	0.53
40	002675	东诚药业	73,600	1,011,264.00	0.53
41	002774	快意电梯	108,200	1,004,096.00	0.53
42	301210	金杨精密	27,400	997,360.00	0.52

43	688096	京源环保	124,061	980,081.90	0.51
44	300836	佰奥智能	17,300	949,770.00	0.50
45	301397	溯联股份	27,120	944,589.60	0.50
46	688371	菲沃泰	50,638	935,283.86	0.49
47	002996	顺博合金	120,000	907,200.00	0.48
48	002933	新兴装备	24,800	897,760.00	0.47
49	301168	通灵股份	19,000	887,300.00	0.47
50	300101	振芯科技	31,100	884,173.00	0.46
51	003017	大洋生物	29,400	877,884.00	0.46
52	301192	泰祥股份	29,500	875,855.00	0.46
53	301119	正强股份	16,500	869,385.00	0.46
54	300190	维尔利	200,100	858,429.00	0.45
55	301266	宇邦新材	23,200	843,320.00	0.44
56	688108	赛诺医疗	43,556	838,017.44	0.44
57	603119	浙江荣泰	7,200	832,824.00	0.44
58	300818	耐普矿机	21,800	825,566.00	0.43
59	605116	奥锐特	32,900	824,145.00	0.43
60	002006	精工科技	35,500	822,180.00	0.43
61	301310	鑫宏业	19,000	816,050.00	0.43
62	300515	三德科技	41,500	815,890.00	0.43
63	300920	润阳科技	17,400	801,618.00	0.42
64	688175	高凌信息	24,691	795,297.11	0.42
65	301225	恒勃股份	4,800	794,400.00	0.42
66	605016	百龙创园	36,400	786,240.00	0.41
67	603040	新坐标	8,500	781,915.00	0.41
68	603966	法兰泰克	65,200	775,880.00	0.41
69	300816	艾可蓝	16,100	775,215.00	0.41
70	000920	沃顿科技	61,700	768,165.00	0.40
71	002876	三利谱	31,900	763,686.00	0.40
72	300488	恒锋工具	22,900	747,456.00	0.39
73	301033	迈普医学	11,000	742,500.00	0.39
74	301129	瑞纳智能	30,800	734,580.00	0.38
75	603786	科博达	9,400	734,140.00	0.38
76	301028	鼎熔岩	50,300	733,374.00	0.38
77	603360	百傲化学	22,700	731,394.00	0.38
78	603725	天安新材	78,800	728,900.00	0.38
79	002917	金奥博	53,500	715,830.00	0.38
80	688659	元琛科技	75,289	711,481.05	0.37
81	605058	澳弘电子	23,300	711,116.00	0.37
82	300661	圣邦股份	10,300	706,992.00	0.37
83	603098	森特股份	50,800	706,628.00	0.37
84	300590	移为通信	54,600	692,328.00	0.36
85	002903	宇环数控	30,000	690,000.00	0.36

86	605305	中际联合	16,400	683,224.00	0.36
87	688310	迈得医疗	44,500	682,185.00	0.36
88	688156	路德科技	42,580	681,705.80	0.36
89	688141	杰华特	15,522	674,120.46	0.35
90	603185	弘元绿能	22,100	674,050.00	0.35
91	002779	中坚科技	5,900	670,004.00	0.35
92	688466	金科环境	41,112	668,892.24	0.35
93	300907	康平科技	22,500	667,350.00	0.35
94	300950	德固特	29,100	665,226.00	0.35
95	300531	优博讯	36,700	662,068.00	0.35
96	688377	迪威尔	17,571	644,855.70	0.34
97	688329	艾隆科技	29,901	636,592.29	0.33
98	688118	普元信息	24,700	630,344.00	0.33
99	300623	捷捷微电	23,100	627,627.00	0.33
100	603192	汇得科技	23,900	627,136.00	0.33
101	300680	隆盛科技	11,200	625,744.00	0.33
102	301608	博实结	6,900	624,726.00	0.33
103	002057	中钢天源	60,700	618,533.00	0.32
104	301000	肇民科技	15,500	610,235.00	0.32
105	300833	浩洋股份	15,000	610,200.00	0.32
106	688191	智洋创新	18,900	608,202.00	0.32
107	688153	唯捷创芯	16,078	605,175.92	0.32
108	002971	和远气体	20,000	597,600.00	0.31
109	300613	富瀚微	12,900	594,174.00	0.31
110	301392	汇成真空	4,600	593,584.00	0.31
111	002970	锐明技术	12,200	591,700.00	0.31
112	001339	智微智能	11,500	587,765.00	0.31
113	001314	亿道信息	13,100	587,011.00	0.31
114	688625	呈和科技	14,200	585,040.00	0.31
115	301349	信德新材	12,300	576,993.00	0.30
116	300752	隆利科技	31,600	576,700.00	0.30
117	301603	乔锋智能	7,600	575,320.00	0.30
118	301391	卡莱特	6,700	568,495.00	0.30
119	301278	快可电子	17,000	568,310.00	0.30
120	300685	艾德生物	27,600	564,696.00	0.30
121	300909	汇创达	11,700	562,770.00	0.29
122	001309	德明利	2,400	556,536.00	0.29
123	301195	北路智控	16,100	555,933.00	0.29
124	002833	弘亚数控	33,300	545,121.00	0.29
125	300305	裕兴股份	89,900	534,905.00	0.28
126	301536	星辰科技	8,900	533,199.00	0.28
127	301175	中科环保	89,500	528,945.00	0.28
128	300241	瑞丰光电	93,800	524,342.00	0.27

129	002170	芭田股份	42,800	521,304.00	0.27
130	603109	神驰机电	20,100	518,379.00	0.27
131	300882	万胜智能	27,100	509,480.00	0.27
132	002825	纳尔股份	44,300	509,007.00	0.27
133	300672	国科微	4,700	505,814.00	0.27
134	688277	天智航	33,172	503,882.68	0.26
135	002322	理工能科	41,800	502,018.00	0.26
136	300606	金太阳	21,100	496,061.00	0.26
137	300809	华辰装备	13,000	494,910.00	0.26
138	603004	鼎龙科技	20,900	490,523.00	0.26
139	688007	光峰科技	26,018	483,154.26	0.25
140	605358	立昂微	13,800	480,516.00	0.25
141	300545	联得装备	15,600	478,764.00	0.25
142	688571	杭华股份	64,031	477,030.95	0.25
143	300853	申昊科技	23,000	476,560.00	0.25
144	300406	九强生物	36,200	473,134.00	0.25
145	300942	易瑞生物	50,100	471,441.00	0.25
146	300435	中泰股份	21,200	471,064.00	0.25
147	300286	安科瑞	20,300	468,524.00	0.25
148	688598	金博股份	15,900	466,824.00	0.24
149	603325	博隆技术	6,000	466,620.00	0.24
150	300695	兆丰股份	4,600	460,276.00	0.24
151	688439	振华风光	6,971	450,326.60	0.24
152	688681	科汇股份	25,584	449,766.72	0.24
153	688395	正弦电气	18,400	447,488.00	0.23
154	301456	盘古智能	14,200	447,300.00	0.23
155	301550	斯菱智驱	3,200	443,840.00	0.23
156	301030	仕净科技	37,500	443,625.00	0.23
157	300508	维宏股份	12,000	442,800.00	0.23
158	002992	宝明科技	9,300	442,773.00	0.23
159	688383	新益昌	5,371	420,388.17	0.22
160	300416	苏试试验	23,500	419,240.00	0.22
161	688046	药康生物	26,831	412,124.16	0.22
162	300876	蒙泰高新	11,500	405,605.00	0.21
163	002255	海陆重工	31,800	401,316.00	0.21
164	605060	联德股份	10,800	399,168.00	0.21
165	300880	迦南智能	22,300	392,034.00	0.21
166	688661	和林微纳	7,543	390,425.68	0.20
167	603256	宏和科技	10,600	390,186.00	0.20
168	301160	翔楼新材	5,400	388,206.00	0.20
169	300777	中简科技	9,400	383,520.00	0.20
170	300715	凯伦股份	36,300	378,972.00	0.20
171	301611	珂玛科技	4,400	377,212.00	0.20

172	300610	晨化股份	32,200	373,842.00	0.20
173	001269	欧晶科技	15,100	363,608.00	0.19
174	002821	凯莱英	3,900	362,427.00	0.19
175	300780	德恩精工	18,500	356,680.00	0.19
176	300775	三角防务	11,700	355,680.00	0.19
177	603496	恒为科技	13,000	354,640.00	0.19
178	688148	芳源股份	39,466	346,116.82	0.18
179	300394	天孚通信	1,700	345,151.00	0.18
180	300893	松原安全	14,600	345,144.00	0.18
181	605123	派克新材	3,300	342,870.00	0.18
182	688435	英方软件	7,252	339,176.04	0.18
183	603893	瑞芯微	1,900	338,732.00	0.18
184	603516	淳中科技	1,500	335,250.00	0.18
185	688623	双元科技	3,500	328,650.00	0.17
186	002860	星帅尔	23,171	326,711.10	0.17
187	688129	东来技术	16,149	326,694.27	0.17
188	300982	苏文电能	16,100	325,059.00	0.17
189	603678	火炬电子	9,100	321,412.00	0.17
190	688468	科美诊断	43,100	316,354.00	0.17
191	300401	花园生物	20,700	312,984.00	0.16
192	603062	麦加芯彩	6,400	302,528.00	0.16
193	300855	图南股份	9,200	297,160.00	0.16
194	301362	民爆光电	7,100	295,289.00	0.15
195	603267	鸿远电子	5,100	277,593.00	0.15
196	002119	康强电子	16,600	273,402.00	0.14
197	688267	中触媒	9,600	270,432.00	0.14
198	688389	普门科技	20,600	267,388.00	0.14
199	688132	邦彦技术	14,177	261,140.34	0.14
200	003031	中瓷电子	3,500	256,060.00	0.13
201	301312	智立方	5,100	254,847.00	0.13
202	300382	斯莱克	16,000	248,960.00	0.13
203	003026	中晶科技	8,000	247,040.00	0.13
204	300447	全信股份	13,500	244,080.00	0.13
205	688359	三孚新科	3,569	237,802.47	0.12
206	002983	芯瑞达	10,300	236,385.00	0.12
207	002409	雅克科技	3,100	229,710.00	0.12
208	300643	万通智控	11,800	229,392.00	0.12
209	301377	鼎泰高科	1,600	222,560.00	0.12
210	301215	中汽股份	32,400	221,940.00	0.12
211	603722	阿科力	5,600	221,032.00	0.12
212	688259	创耀科技	5,272	220,369.60	0.12
213	300385	雪浪环境	35,400	220,188.00	0.12
214	301325	曼恩斯特	4,300	217,365.00	0.11

215	300757	罗博特科	900	209,970.00	0.11
216	301179	泽宇智能	13,200	208,692.00	0.11
217	688403	汇成股份	12,500	204,750.00	0.11
218	301413	安培龙	1,500	202,200.00	0.11
219	000960	锡业股份	7,200	200,736.00	0.11
220	300314	戴维医疗	15,300	192,474.00	0.10
221	002993	奥海科技	4,400	192,324.00	0.10
222	603657	春光科技	6,300	187,740.00	0.10
223	688253	英诺特	6,200	187,116.00	0.10
224	300727	润禾材料	5,200	185,328.00	0.10
225	301196	唯科科技	2,300	185,311.00	0.10
226	300470	中密控股	4,900	184,240.00	0.10
227	600195	中牧股份	23,100	181,797.00	0.10
228	688630	芯碁微装	1,349	181,480.97	0.10
229	688041	海光信息	800	179,528.00	0.09
230	002293	罗莱生活	17,200	176,644.00	0.09
231	688143	长盈通	3,500	175,735.00	0.09
232	603912	佳力图	20,500	175,685.00	0.09
233	603681	永冠新材	9,200	174,616.00	0.09
234	300404	博济医药	18,600	173,538.00	0.09
235	603236	移远通信	1,800	171,738.00	0.09
236	002851	麦格米特	1,900	171,133.00	0.09
237	301581	黄山谷捷	3,600	170,820.00	0.09
238	300302	同有科技	9,400	170,516.00	0.09
239	300548	长芯博创	1,200	170,400.00	0.09
240	603306	华懋科技	2,700	170,127.00	0.09
241	300706	阿石创	4,900	166,257.00	0.09
242	002478	常宝股份	19,400	164,318.00	0.09
243	688448	磁谷科技	3,300	159,951.00	0.08
244	688209	英集芯	7,600	151,544.00	0.08
245	001301	尚太科技	1,700	145,877.00	0.08
246	000415	渤海租赁	35,800	144,990.00	0.08
247	002687	乔治白	29,100	140,262.00	0.07
248	688045	必易微	3,616	139,903.04	0.07
249	688613	奥精医疗	6,800	138,108.00	0.07
250	002698	博实股份	8,200	137,842.00	0.07
251	603385	惠达卫浴	20,100	137,484.00	0.07
252	600966	博汇纸业	20,100	137,283.00	0.07
253	600269	赣粤高速	25,900	134,421.00	0.07
254	603317	天味食品	10,700	133,964.00	0.07
255	601518	吉林高速	47,500	133,950.00	0.07
256	688233	神工股份	1,900	133,057.00	0.07
257	002152	广电运通	9,600	132,576.00	0.07

258	300172	中电环保	24,300	132,435.00	0.07
259	300806	斯迪克	4,300	132,182.00	0.07
260	603967	中创物流	9,600	131,808.00	0.07
261	000959	首钢股份	26,800	131,320.00	0.07
262	603700	宁水集团	9,500	129,105.00	0.07
263	000528	柳工	10,700	127,009.00	0.07
264	301396	宏景科技	1,900	125,970.00	0.07
265	301323	新莱福	2,300	125,511.00	0.07
266	688387	信科移动	9,600	123,840.00	0.06
267	605488	福莱新材	3,600	123,660.00	0.06
268	605567	春雪食品	11,100	122,100.00	0.06
269	300200	高盟新材	10,400	121,784.00	0.06
270	300213	佳讯飞鸿	12,700	120,904.00	0.06
271	688159	有方科技	2,500	120,850.00	0.06
272	603375	盛景微	3,300	120,450.00	0.06
273	301367	瑞迈特	1,400	119,994.00	0.06
274	002139	拓邦股份	8,600	118,508.00	0.06
275	300586	美联新材	10,800	117,612.00	0.06
276	603808	歌力思	13,800	117,576.00	0.06
277	600572	康恩贝	26,300	117,298.00	0.06
278	002367	康力电梯	14,400	116,064.00	0.06
279	688778	厦钨新能	1,500	116,055.00	0.06
280	300956	英力股份	6,900	114,816.00	0.06
281	688246	嘉和美康	4,900	113,925.00	0.06
282	002880	卫光生物	4,400	112,200.00	0.06
283	002815	崇达技术	8,200	112,012.00	0.06
284	603043	广州酒家	6,300	111,069.00	0.06
285	002498	汉缆股份	28,700	109,921.00	0.06
286	600732	爱旭股份	8,200	109,880.00	0.06
287	002899	英派斯	4,000	109,480.00	0.06
288	002798	帝欧水华	19,100	109,443.00	0.06
289	300862	蓝盾光电	4,700	107,536.00	0.06
290	600623	华谊集团	13,900	107,169.00	0.06
291	300707	威唐工业	6,500	106,925.00	0.06
292	603520	司太立	11,300	106,220.00	0.06
293	300839	博汇股份	8,800	105,952.00	0.06
294	000887	中鼎股份	4,500	104,445.00	0.05
295	002454	松芝股份	11,800	102,778.00	0.05
296	688678	福立旺	4,200	101,556.00	0.05
297	002440	闰土股份	13,500	100,845.00	0.05
298	300055	万邦达	12,300	100,245.00	0.05
299	600236	桂冠电力	12,800	100,224.00	0.05
300	300767	震安科技	4,800	99,840.00	0.05

301	603380	易德龙	2,600	98,800.00	0.05
302	688022	瀚川智能	6,418	98,195.40	0.05
303	003038	鑫铂股份	6,200	97,960.00	0.05
304	688248	南网科技	2,183	97,667.42	0.05
305	300360	炬华科技	5,600	97,384.00	0.05
306	688060	云涌科技	2,300	97,359.00	0.05
307	600219	南山铝业	18,000	96,840.00	0.05
308	600969	郴电国际	9,300	95,139.00	0.05
309	002946	新乳业	5,100	94,503.00	0.05
310	603324	盛剑科技	3,800	94,126.00	0.05
311	000589	贵州轮胎	17,900	92,722.00	0.05
312	688062	迈威生物	2,410	92,712.70	0.05
313	300762	上海瀚讯	2,200	91,696.00	0.05
314	600901	江苏金租	14,800	90,576.00	0.05
315	603579	荣泰健康	3,800	90,478.00	0.05
316	688323	瑞华泰	4,018	90,445.18	0.05
317	688261	东微半导	1,100	90,211.00	0.05
318	688691	灿芯股份	883	90,048.34	0.05
319	300365	恒华科技	14,200	89,744.00	0.05
320	600510	黑牡丹	10,400	87,256.00	0.05
321	688503	聚和材料	1,428	87,108.00	0.05
322	600742	富维股份	8,600	86,000.00	0.05
323	605389	长龄液压	1,100	85,800.00	0.04
324	601107	四川成渝	14,100	85,728.00	0.04
325	300083	创世纪	9,100	83,811.00	0.04
326	601187	厦门银行	11,400	83,676.00	0.04
327	002668	TCL 智家	8,000	83,040.00	0.04
328	000932	华菱钢铁	14,600	82,052.00	0.04
329	603183	建研院	19,000	81,890.00	0.04
330	688055	龙腾光电	22,543	81,154.80	0.04
331	688536	思瑞浦	502	80,259.76	0.04
332	002158	汉钟精机	3,200	80,096.00	0.04
333	603978	深圳新星	2,800	79,072.00	0.04
334	000728	国元证券	9,400	78,490.00	0.04
335	301389	隆扬电子	1,400	76,412.00	0.04
336	300446	航天智造	3,000	76,020.00	0.04
337	002649	博彦科技	5,700	75,183.00	0.04
338	002493	荣盛石化	6,400	74,944.00	0.04
339	002807	江阴银行	16,200	74,034.00	0.04
340	002385	大北农	18,500	74,000.00	0.04
341	601968	宝钢包装	13,800	73,692.00	0.04
342	600266	城建发展	14,500	73,515.00	0.04
343	002204	大连重工	9,600	73,440.00	0.04

344	300408	三环集团	1,600	73,200.00	0.04
345	300510	金冠股份	17,700	73,101.00	0.04
346	002052	同洲电子	5,600	71,400.00	0.04
347	002099	海翔药业	11,300	70,512.00	0.04
348	603887	城地香江	5,200	70,304.00	0.04
349	000739	普洛药业	4,300	69,961.00	0.04
350	603601	再升科技	5,600	69,832.00	0.04
351	603378	亚士创能	10,200	69,462.00	0.04
352	688618	三旺通信	2,600	69,316.00	0.04
353	688295	中复神鹰	2,100	68,901.00	0.04
354	600284	浦东建设	8,200	68,880.00	0.04
355	600986	浙文互联	8,800	68,816.00	0.04
356	300813	泰林生物	2,800	68,796.00	0.04
357	603811	诚意药业	6,500	68,250.00	0.04
358	002314	南山控股	23,900	68,115.00	0.04
359	300217	东方电热	13,100	67,858.00	0.04
360	688400	凌云光	1,600	67,808.00	0.04
361	300079	数码视讯	12,500	67,375.00	0.04
362	601963	重庆银行	6,200	67,146.00	0.04
363	301548	崇德科技	1,200	66,372.00	0.03
364	688551	科威尔	1,800	66,294.00	0.03
365	300464	星徽股份	10,400	65,936.00	0.03
366	688560	明冠新材	4,600	65,734.00	0.03
367	603138	海量数据	4,600	65,412.00	0.03
368	603350	安乃达	1,700	64,753.00	0.03
369	002216	三全食品	5,700	64,353.00	0.03
370	002206	海利得	10,900	63,765.00	0.03
371	603381	永臻股份	3,200	63,552.00	0.03
372	600386	北巴传媒	14,400	63,216.00	0.03
373	603365	水星家纺	3,000	63,120.00	0.03
374	300428	立中集团	2,700	63,045.00	0.03
375	688048	长光华芯	500	62,675.00	0.03
376	605166	聚合顺	6,000	62,220.00	0.03
377	603319	美湖股份	1,700	62,186.00	0.03
378	688478	晶升股份	1,619	60,566.79	0.03
379	000726	鲁泰 A	8,500	60,520.00	0.03
380	002997	瑞鹄模具	1,600	59,840.00	0.03
381	688026	洁特生物	3,700	59,607.00	0.03
382	688314	康拓医疗	1,800	59,508.00	0.03
383	600446	金证股份	3,700	58,904.00	0.03
384	688355	明志科技	3,300	58,740.00	0.03
385	300550	和仁科技	4,000	58,040.00	0.03
386	603191	望变电气	3,900	57,759.00	0.03

387	002233	塔牌集团	6,400	57,664.00	0.03
388	002407	多氟多	1,700	57,647.00	0.03
389	300881	盛德鑫泰	1,700	57,562.00	0.03
390	601231	环旭电子	1,900	57,000.00	0.03
391	603866	桃李面包	10,800	56,808.00	0.03
392	000825	太钢不锈	11,600	56,724.00	0.03
393	688167	炬光科技	323	56,547.61	0.03
394	688312	燕麦科技	1,700	56,406.00	0.03
395	603809	豪能股份	3,900	55,965.00	0.03
396	603088	宁波精达	5,400	55,782.00	0.03
397	688591	泰凌微	1,300	55,328.00	0.03
398	003033	征和工业	700	55,027.00	0.03
399	300655	晶瑞电材	3,400	54,842.00	0.03
400	600335	国机汽车	8,400	54,684.00	0.03
401	300354	东华测试	1,200	54,600.00	0.03
402	301150	中一科技	1,300	54,587.00	0.03
403	688020	方邦股份	800	54,416.00	0.03
404	603826	坤彩科技	3,200	54,400.00	0.03
405	601126	四方股份	1,800	54,144.00	0.03
406	301080	百普赛斯	1,000	54,000.00	0.03
407	301511	德福科技	1,500	53,685.00	0.03
408	301383	天键股份	1,500	53,460.00	0.03
409	002408	齐翔腾达	10,900	53,192.00	0.03
410	301269	华大九天	500	53,165.00	0.03
411	300817	双飞集团	2,500	53,025.00	0.03
412	688223	晶科能源	9,399	53,010.36	0.03
413	600359	新农开发	7,400	52,910.00	0.03
414	002839	张家港行	11,500	52,555.00	0.03
415	000811	冰轮环境	2,800	51,856.00	0.03
416	002381	双箭股份	7,800	51,402.00	0.03
417	603728	鸣志电器	700	50,645.00	0.03
418	000783	长江证券	6,200	50,530.00	0.03
419	300474	景嘉微	700	50,309.00	0.03
420	688123	聚辰股份	400	50,232.00	0.03
421	300601	康泰生物	3,400	50,218.00	0.03
422	688567	孚能科技	3,200	50,080.00	0.03
423	601369	陕鼓动力	5,000	50,050.00	0.03
424	688088	虹软科技	1,007	49,846.50	0.03
425	300009	安科生物	5,200	49,764.00	0.03
426	300776	帝尔激光	800	49,712.00	0.03
427	300398	飞凯材料	2,200	49,302.00	0.03
428	002935	天奥电子	2,200	49,170.00	0.03
429	688058	宝兰德	1,784	48,578.32	0.03

430	300493	润欣科技	2,400	48,216.00	0.03
431	600867	通化东宝	5,900	48,203.00	0.03
432	603587	地素时尚	3,600	48,096.00	0.03
433	600029	南方航空	6,000	48,060.00	0.03
434	002884	凌霄泵业	2,700	47,763.00	0.03
435	002701	奥瑞金	7,900	47,005.00	0.02
436	600782	新钢股份	12,100	46,948.00	0.02
437	002948	青岛银行	10,400	46,592.00	0.02
438	002396	星网锐捷	1,500	45,450.00	0.02
439	603112	华翔股份	2,600	45,162.00	0.02
440	300480	光力科技	2,700	45,117.00	0.02
441	603303	得邦照明	3,500	45,115.00	0.02
442	002984	森麒麟	2,100	44,457.00	0.02
443	601222	林洋能源	8,100	44,307.00	0.02
444	002234	民和股份	5,100	43,962.00	0.02
445	600808	马钢股份	10,400	43,888.00	0.02
446	603969	银龙股份	4,300	43,473.00	0.02
447	601233	桐昆股份	2,500	43,025.00	0.02
448	002228	合兴包装	9,300	42,966.00	0.02
448	002672	东江环保	9,300	42,966.00	0.02
449	688658	悦康药业	1,900	42,959.00	0.02
450	600339	中油工程	12,600	42,210.00	0.02
451	300566	激智科技	2,300	42,205.00	0.02
452	301102	兆讯传媒	4,000	41,960.00	0.02
453	002157	正邦科技	12,800	41,472.00	0.02
454	300587	天铁科技	6,700	41,071.00	0.02
455	688428	诺诚健华	1,965	40,321.80	0.02
456	000630	铜陵有色	6,700	40,267.00	0.02
457	601866	中远海发	15,900	40,068.00	0.02
458	688238	和元生物	5,992	39,906.72	0.02
459	002497	雅化集团	1,600	39,600.00	0.02
460	002627	三峡旅游	5,100	37,842.00	0.02
461	688639	华恒生物	1,154	37,597.32	0.02
462	600906	财达证券	5,600	37,352.00	0.02
463	688280	精进电动	4,281	37,244.70	0.02
464	301070	开勒股份	600	36,930.00	0.02
465	300666	江丰电子	400	36,800.00	0.02
466	000498	山东路桥	6,100	36,783.00	0.02
467	603611	诺力股份	1,500	36,675.00	0.02
468	300883	龙利得	5,400	36,450.00	0.02
469	000503	国新健康	4,100	36,408.00	0.02
470	301656	联合动力	1,424	36,255.04	0.02
471	300648	星云股份	700	36,106.00	0.02

472	000030	富奥股份	6,200	35,588.00	0.02
473	688033	天宜新材	4,600	35,420.00	0.02
474	688700	东威科技	1,000	35,280.00	0.02
475	603301	振德医疗	500	35,250.00	0.02
476	603707	健友股份	3,900	35,217.00	0.02
477	002062	宏润建设	3,800	35,150.00	0.02
478	300193	佳士科技	3,900	34,905.00	0.02
479	002390	信邦制药	10,800	34,776.00	0.02
480	601528	瑞丰银行	6,100	34,770.00	0.02
481	301327	华宝新能	600	34,602.00	0.02
482	300425	中建环能	6,900	34,155.00	0.02
483	002641	公元股份	7,900	34,128.00	0.02
484	300445	康斯特	1,300	33,878.00	0.02
485	002449	国星光电	4,000	33,840.00	0.02
486	002585	双星新材	5,000	33,650.00	0.02
487	601339	百隆东方	5,800	33,582.00	0.02
488	600790	轻纺城	8,700	33,321.00	0.02
489	001280	中国铀业	729	33,067.44	0.02
490	600425	青松建化	7,900	32,864.00	0.02
491	600662	外服控股	6,500	32,630.00	0.02
492	002608	江苏国信	4,400	32,516.00	0.02
493	300639	凯普生物	6,000	32,280.00	0.02
494	600331	宏达股份	2,500	31,975.00	0.02
495	000401	金隅冀东	7,200	31,752.00	0.02
496	600207	安彩高科	6,100	31,415.00	0.02
497	300463	迈克生物	2,800	31,332.00	0.02
498	601228	广州港	9,600	31,104.00	0.02
499	688320	禾川科技	831	31,012.92	0.02
500	002419	天虹股份	5,600	30,968.00	0.02
501	600248	陕建股份	8,700	30,711.00	0.02
502	000301	东方盛虹	2,800	30,492.00	0.02
503	002063	远光软件	5,000	30,350.00	0.02
504	600987	航民股份	4,400	30,316.00	0.02
505	688589	力合微	1,329	30,234.75	0.02
506	000404	长虹华意	4,400	29,788.00	0.02
507	600305	恒顺醋业	3,700	29,304.00	0.02
508	002606	大连电瓷	3,300	28,842.00	0.02
509	000598	兴蓉环境	4,000	28,680.00	0.02
510	600597	光明乳业	3,500	28,315.00	0.01
511	688262	国芯科技	920	27,922.00	0.01
512	002958	青农商行	8,900	27,590.00	0.01
513	688484	南芯科技	678	27,567.48	0.01
514	600500	中化国际	7,000	27,440.00	0.01

515	688319	欧林生物	1,074	27,236.64	0.01
516	605008	长鸿高科	1,900	27,113.00	0.01
517	002705	新宝股份	1,900	27,094.00	0.01
518	002897	意华股份	500	27,035.00	0.01
519	688636	智明达	631	27,032.04	0.01
520	300703	创源股份	1,100	26,884.00	0.01
521	300174	元力股份	1,700	26,350.00	0.01
522	600962	国投中鲁	1,200	26,316.00	0.01
523	600888	新疆众和	3,200	26,208.00	0.01
524	000591	太阳能	5,900	26,196.00	0.01
525	002755	奥赛康	1,600	26,128.00	0.01
526	002752	昇兴股份	3,900	25,896.00	0.01
527	688080	映翰通	510	25,755.00	0.01
528	002614	奥佳华	3,500	25,585.00	0.01
529	000623	吉林敖东	1,300	25,389.00	0.01
530	300257	开山股份	1,800	25,290.00	0.01
531	688218	江苏北人	1,100	25,102.00	0.01
532	601138	工业富联	400	24,820.00	0.01
533	600409	三友化工	4,000	24,760.00	0.01
534	300793	佳禾智能	1,500	24,465.00	0.01
535	688328	深科达	836	24,394.48	0.01
536	600039	四川路桥	2,400	23,880.00	0.01
537	600057	厦门象屿	2,800	23,856.00	0.01
538	600928	西安银行	6,400	23,680.00	0.01
539	300702	天宇股份	1,000	23,600.00	0.01
540	301606	绿联科技	400	23,496.00	0.01
541	300422	博世科	5,100	23,409.00	0.01
542	002043	兔宝宝	1,600	23,056.00	0.01
543	601801	皖新传媒	3,500	23,030.00	0.01
544	601827	三峰环境	2,700	22,869.00	0.01
545	000717	中南股份	8,800	22,792.00	0.01
546	000021	深科技	900	22,752.00	0.01
547	002132	恒星科技	6,400	22,720.00	0.01
548	002475	立讯精密	400	22,684.00	0.01
549	002532	天山铝业	1,400	22,652.00	0.01
550	002302	西部建设	3,700	22,644.00	0.01
551	600477	杭萧钢构	7,600	22,572.00	0.01
552	600449	宁夏建材	1,800	22,248.00	0.01
553	600918	中泰证券	3,400	22,100.00	0.01
554	002859	洁美科技	800	22,080.00	0.01
555	002064	华峰化学	2,000	22,000.00	0.01
556	603989	艾华集团	1,300	21,814.00	0.01
557	688382	益方生物	800	21,792.00	0.01

558	000012	南玻A	4,900	21,707.00	0.01
559	600390	五矿资本	3,900	21,645.00	0.01
560	002144	宏达高科	1,700	21,573.00	0.01
561	600428	中远海特	3,000	21,300.00	0.01
562	002539	云图控股	1,800	21,276.00	0.01
563	002746	仙坛股份	3,500	21,245.00	0.01
564	002791	坚朗五金	1,000	21,210.00	0.01
565	600688	上海石化	7,600	21,128.00	0.01
566	300991	创益通	500	21,090.00	0.01
567	002108	沧州明珠	4,400	20,988.00	0.01
568	301230	泓博医药	700	20,909.00	0.01
569	600075	新疆天业	4,200	20,790.00	0.01
570	300393	中来股份	3,100	20,770.00	0.01
571	300595	欧普康视	1,400	20,566.00	0.01
572	688023	安恒信息	400	20,564.00	0.01
573	600655	豫园股份	4,000	20,520.00	0.01
574	600649	城投控股	4,600	20,470.00	0.01
575	300098	高新兴	3,300	20,130.00	0.01
576	002219	新里程	9,400	20,022.00	0.01
577	301062	上海艾录	2,400	19,776.00	0.01
578	002110	三钢闽光	4,500	19,755.00	0.01
579	601778	晶科科技	5,200	19,344.00	0.01
580	301039	中集车辆	2,100	19,215.00	0.01
581	301018	申菱环境	300	19,056.00	0.01
582	002111	威海广泰	1,800	18,936.00	0.01
583	002127	南极电商	5,600	18,872.00	0.01
584	601865	福莱特	1,200	18,804.00	0.01
585	300889	爱克股份	900	18,630.00	0.01
586	002479	富春环保	3,800	18,620.00	0.01
587	000629	钒钛股份	6,000	18,600.00	0.01
587	600008	首创环保	6,200	18,600.00	0.01
588	002989	中天精装	600	18,504.00	0.01
589	688709	成都华微	400	18,396.00	0.01
590	600469	风神股份	2,600	18,044.00	0.01
591	600740	山西焦化	4,700	17,672.00	0.01
592	603233	大参林	1,000	17,620.00	0.01
593	688334	西高院	900	17,424.00	0.01
594	301263	泰恩康	600	17,394.00	0.01
595	301237	和顺科技	300	17,373.00	0.01
596	688693	锆威特	464	17,372.16	0.01
597	600629	华建集团	800	17,360.00	0.01
598	600295	鄂尔多斯	1,400	17,304.00	0.01
599	002334	英威腾	1,900	17,138.00	0.01

600	600429	三元股份	3,300	17,094.00	0.01
601	603638	艾迪精密	900	17,037.00	0.01
602	300348	长亮科技	1,100	17,028.00	0.01
603	003013	地铁设计	1,200	17,004.00	0.01
604	688133	泰坦科技	766	16,959.24	0.01
605	002441	众业达	1,800	16,920.00	0.01
606	603759	海天股份	1,600	16,864.00	0.01
607	300523	辰安科技	700	16,751.00	0.01
608	300457	赢合科技	600	16,710.00	0.01
609	300911	亿田智能	500	16,650.00	0.01
610	601886	江河集团	2,000	16,320.00	0.01
611	002375	亚厦股份	4,300	16,297.00	0.01
612	301090	华润材料	2,300	16,192.00	0.01
613	688176	亚虹医药	1,400	16,114.00	0.01
614	600956	新天绿能	2,200	15,950.00	0.01
615	002135	东南网架	3,500	15,890.00	0.01
616	002172	澳洋健康	4,000	15,880.00	0.01
617	600968	海油发展	4,100	15,744.00	0.01
618	601163	三角轮胎	1,100	15,719.00	0.01
619	300453	三鑫医疗	1,800	15,696.00	0.01
620	603968	醋化股份	1,400	15,638.00	0.01
621	603699	纽威股份	300	15,591.00	0.01
622	301162	国能日新	300	15,378.00	0.01
623	603816	顾家家居	500	15,370.00	0.01
624	688365	光云科技	900	15,183.00	0.01
625	000402	金融街	5,500	15,125.00	0.01
626	002790	瑞尔特	1,800	15,102.00	0.01
627	002025	航天电器	300	15,039.00	0.01
628	002572	索菲亚	1,100	14,971.00	0.01
629	300320	海达股份	1,600	14,928.00	0.01
630	000550	江铃汽车	800	14,880.00	0.01
631	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.01
632	003035	南网能源	3,200	14,656.00	0.01
633	600558	大西洋	2,400	14,640.00	0.01
634	000862	银星能源	2,500	14,600.00	0.01
635	688718	唯赛勃	1,100	14,388.00	0.01
636	300737	科顺股份	2,600	14,300.00	0.01
637	688315	诺禾致源	1,060	14,076.80	0.01
638	002081	金螳螂	4,100	14,022.00	0.01
639	600963	岳阳林纸	3,000	14,010.00	0.01
640	603878	武进不锈	1,500	13,890.00	0.01
641	603737	三棵树	300	13,881.00	0.01
642	002481	双塔食品	2,700	13,797.00	0.01

643	601068	中铝国际	2,600	13,754.00	0.01
644	000791	甘肃能源	2,100	13,545.00	0.01
645	600395	盘江股份	2,900	13,514.00	0.01
646	300968	格林精密	900	13,401.00	0.01
647	300230	永利股份	2,800	13,384.00	0.01
648	688609	九联科技	1,300	13,273.00	0.01
649	688381	帝奥微	580	13,229.80	0.01
650	000789	万年青	2,500	13,075.00	0.01
651	603788	宁波高发	800	13,072.00	0.01
652	000761	本钢板材	3,900	13,065.00	0.01
653	002254	泰和新材	1,300	13,026.00	0.01
654	603689	皖天然气	1,600	12,976.00	0.01
655	601101	昊华能源	1,800	12,888.00	0.01
656	688030	山石网科	705	12,809.85	0.01
657	002782	可立克	700	12,712.00	0.01
658	001386	马可波罗	681	12,618.93	0.01
659	601155	新城控股	900	12,555.00	0.01
660	002225	濮耐股份	2,200	12,540.00	0.01
661	600681	百川能源	2,900	12,528.00	0.01
662	688162	巨一科技	400	12,320.00	0.01
663	600997	开滦股份	2,100	12,075.00	0.01
664	603888	新华网	620	12,046.60	0.01
665	301584	建发致新	447	11,988.54	0.01
666	002042	华孚时尚	2,800	11,900.00	0.01
667	688533	上声电子	400	11,696.00	0.01
668	688351	微电生理	500	11,575.00	0.01
669	002420	毅昌科技	1,500	11,535.00	0.01
670	000936	华西股份	1,400	11,522.00	0.01
671	601388	怡球资源	3,800	11,438.00	0.01
672	002434	万里扬	1,200	11,436.00	0.01
673	603170	宝立食品	800	11,424.00	0.01
674	002918	蒙娜丽莎	800	11,384.00	0.01
675	002991	甘源食品	200	11,382.00	0.01
676	688809	强一股份	55	11,182.05	0.01
677	603987	康德莱	1,300	11,180.00	0.01
678	688089	嘉必优	479	11,151.12	0.01
679	688035	德邦科技	226	10,904.50	0.01
680	603330	天洋新材	1,500	10,860.00	0.01
681	688727	恒坤新材	308	10,739.96	0.01
682	301638	南网数字	754	10,714.34	0.01
683	603217	元利科技	400	10,248.00	0.01
684	688687	凯因科技	407	10,142.44	0.01
685	301509	金凯生科	300	10,134.00	0.01

686	600908	无锡银行	1,700	10,081.00	0.01
687	688807	优迅股份	74	10,031.44	0.01
688	688595	芯海科技	300	9,840.00	0.01
689	688548	广钢气体	668	9,712.72	0.01
690	688138	清溢光电	326	9,180.16	0.00
691	688795	摩尔线程	22	9,155.96	0.00
692	300396	迪瑞医疗	700	9,030.00	0.00
693	603313	梦百合	1,000	8,900.00	0.00
694	000860	顺鑫农业	600	8,790.00	0.00
695	300973	立高食品	200	8,600.00	0.00
696	000036	华联控股	1,300	8,580.00	0.00
697	601600	中国铝业	700	8,554.00	0.00
698	688601	力芯微	200	8,518.00	0.00
699	301687	新广益	152	8,267.28	0.00
700	002571	德力股份	700	8,232.00	0.00
701	600814	杭州解百	1,000	8,100.00	0.00
702	300315	掌趣科技	1,600	7,904.00	0.00
703	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
704	605555	德昌股份	400	7,320.00	0.00
705	603175	超颖电子	143	6,944.08	0.00
706	688796	百奥赛图	164	6,929.00	0.00
707	002544	普天科技	200	6,898.00	0.00
708	001233	海安集团	132	6,848.16	0.00
709	300996	普联软件	400	6,616.00	0.00
710	605318	法狮龙	100	6,517.00	0.00
711	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
712	600313	农发种业	900	5,796.00	0.00
713	001286	陕西能源	600	5,586.00	0.00
714	688802	沐曦股份	13	5,191.03	0.00
715	003027	同兴科技	200	4,460.00	0.00
716	300592	华凯易佰	400	4,344.00	0.00
717	300553	集智股份	100	4,039.00	0.00
718	001369	双欣材料	287	3,699.43	0.00
719	300612	宣亚国际	200	3,562.00	0.00
720	002404	嘉欣丝绸	500	3,505.00	0.00
721	605196	华通线缆	100	3,474.00	0.00
722	000069	华侨城 A	1,400	3,472.00	0.00
723	603418	友升股份	58	3,425.48	0.00
724	300824	北鼎股份	300	3,393.00	0.00
725	000544	中原环保	400	3,328.00	0.00
726	001285	瑞立科密	59	3,308.72	0.00
727	688526	科前生物	200	3,052.00	0.00
728	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00

729	300443	金雷股份	100	2,813.00	0.00
730	601872	招商轮船	300	2,694.00	0.00
731	603092	德力佳	48	2,671.68	0.00
732	688602	康鹏科技	300	2,604.00	0.00
733	002511	中顺洁柔	300	2,568.00	0.00
734	688790	昂瑞微	21	2,460.99	0.00
735	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
736	603334	丰倍生物	74	2,428.68	0.00
737	603600	永艺股份	200	2,374.00	0.00
738	600217	中再资环	500	2,040.00	0.00
739	002840	华统股份	200	1,924.00	0.00
740	300772	运达股份	100	1,906.00	0.00
741	600897	厦门空港	100	1,720.00	0.00
742	300218	安利股份	100	1,625.00	0.00
743	603890	春秋电子	100	1,613.00	0.00
744	300349	金卡智能	100	1,563.00	0.00
745	600535	天士力	100	1,507.00	0.00
746	603071	物产环能	100	1,322.00	0.00
747	600802	福建水泥	200	1,312.00	0.00
748	300565	科信技术	100	1,261.00	0.00
749	603916	苏博特	100	946.00	0.00
750	603105	芯能科技	100	919.00	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	002825	纳尔股份	2,804,275.00	11.42
2	001332	锡装股份	2,743,205.28	11.17
3	603041	美思德	2,654,033.00	10.81
4	300406	九强生物	2,349,807.00	9.57
5	300515	三德科技	2,318,227.00	9.44
6	002833	弘亚数控	2,312,454.00	9.42
7	002675	东诚药业	2,292,434.00	9.34
8	300685	艾德生物	2,260,720.00	9.21
9	603678	火炬电子	2,247,292.00	9.15
10	002971	和远气体	2,220,533.40	9.04
11	605183	确成股份	2,216,746.00	9.03
12	301310	鑫宏业	2,193,460.00	8.93
13	002933	新兴装备	2,189,564.00	8.92
14	003025	思进智能	2,181,159.40	8.88
15	603966	法兰泰克	2,166,641.00	8.82
16	002747	埃斯顿	2,165,923.00	8.82
17	001205	盛航股份	2,161,194.00	8.80

18	300470	中密控股	2,154,304.00	8.77
19	300926	博俊科技	2,151,740.00	8.76
20	603115	海星股份	2,150,501.00	8.76
21	001223	欧克科技	2,141,432.00	8.72
22	300371	汇中股份	2,130,150.00	8.68
23	603681	永冠新材	2,123,946.00	8.65
24	301007	德迈仕	2,120,232.00	8.64
25	300360	炬华科技	2,116,232.20	8.62
26	688132	邦彦技术	2,115,225.74	8.62
27	301283	聚胶股份	2,115,046.77	8.61
28	300777	中简科技	2,112,649.00	8.60
29	603489	八方股份	2,098,704.00	8.55
30	300920	润阳科技	2,095,247.80	8.53
31	300833	浩洋股份	2,093,603.65	8.53
32	603722	阿科力	2,063,108.00	8.40
33	002545	东方铁塔	2,061,084.00	8.39
34	603109	神驰机电	2,052,126.00	8.36
35	002324	普利特	2,049,543.00	8.35
36	603192	汇得科技	2,033,211.00	8.28
37	603938	三孚股份	2,027,474.00	8.26
38	300643	万通智控	2,011,000.00	8.19
39	688156	路德科技	1,988,519.53	8.10
40	002947	恒铭达	1,986,065.00	8.09
41	002996	顺博合金	1,977,279.00	8.05
42	603325	博隆技术	1,972,837.80	8.04
43	603004	鼎龙科技	1,969,909.01	8.02
44	605116	奥锐特	1,963,532.00	8.00
45	300916	朗特智能	1,948,669.00	7.94
46	300488	恒锋工具	1,942,574.00	7.91
47	603950	长源东谷	1,936,546.00	7.89
48	002587	奥拓电子	1,929,232.00	7.86
49	301397	溯联股份	1,915,617.00	7.80
50	301278	快可电子	1,915,116.00	7.80
51	688329	艾隆科技	1,913,506.95	7.79
52	605167	利柏特	1,902,469.00	7.75
53	603520	司太立	1,901,234.00	7.74
54	603267	鸿远电子	1,898,850.00	7.73
55	603786	科博达	1,897,811.00	7.73
56	301266	宇邦新材	1,882,909.00	7.67
57	300508	维宏股份	1,876,633.00	7.64
58	301028	鼎熔岩	1,872,847.00	7.63
59	301195	北路智控	1,869,867.50	7.62
60	603098	森特股份	1,858,580.00	7.57

61	002983	芯瑞达	1,858,510.01	7.57
62	603725	天安新材	1,849,163.60	7.53
63	605016	百龙创园	1,847,577.00	7.52
64	300876	蒙泰高新	1,837,710.00	7.48
65	605389	长龄液压	1,824,219.40	7.43
66	002903	宇环数控	1,822,989.00	7.42
67	300909	汇创达	1,820,805.00	7.42
68	300780	德恩精工	1,803,760.00	7.35
69	603203	快克智能	1,794,817.78	7.31
70	301273	瑞晨环保	1,794,060.00	7.31
71	605060	联德股份	1,790,611.00	7.29
72	603281	江瀚新材	1,783,962.00	7.27
73	002876	三利谱	1,782,468.00	7.26
74	301175	中科环保	1,774,230.00	7.23
75	002821	凯莱英	1,771,554.00	7.22
76	300286	安科瑞	1,761,795.00	7.18
77	300416	苏试试验	1,759,295.40	7.17
78	002810	山东赫达	1,758,481.00	7.16
79	300590	移为通信	1,749,131.00	7.12
80	300447	全信股份	1,743,807.00	7.10
81	301603	乔锋智能	1,740,344.00	7.09
82	300404	博济医药	1,735,576.00	7.07
83	301192	泰祥股份	1,729,682.00	7.04
84	603062	麦加芯彩	1,727,964.00	7.04
85	301119	正强股份	1,721,126.00	7.01
86	001306	夏厦精密	1,712,942.00	6.98
87	301391	卡莱特	1,702,575.00	6.93
88	002774	快意电梯	1,700,180.00	6.92
89	300510	金冠股份	1,699,513.00	6.92
90	300586	美联新材	1,699,350.00	6.92
91	603088	宁波精达	1,698,041.00	6.92
92	605305	中际联合	1,697,727.00	6.91
93	002829	星网宇达	1,695,717.00	6.91
94	301080	百普赛斯	1,681,282.00	6.85
95	001339	智微智能	1,680,749.00	6.85
96	688371	菲沃泰	1,665,992.07	6.79
97	300190	维尔利	1,662,524.00	6.77
98	002993	奥海科技	1,657,902.00	6.75
99	688623	双元科技	1,638,412.92	6.67
100	301210	金杨精密	1,637,879.00	6.67
101	300942	易瑞生物	1,636,344.00	6.66
102	300305	裕兴股份	1,634,045.00	6.66
103	605123	派克新材	1,616,816.27	6.59

104	002779	中坚科技	1,615,952.00	6.58
105	002006	精工科技	1,615,936.00	6.58
106	002057	中钢天源	1,612,275.00	6.57
107	301280	珠城科技	1,602,958.20	6.53
108	300385	雪浪环境	1,599,990.44	6.52
109	603040	新坐标	1,598,207.00	6.51
110	002970	锐明技术	1,589,994.00	6.48
111	603701	德宏股份	1,577,941.00	6.43
112	002255	海陆重工	1,574,158.00	6.41
113	300809	华辰装备	1,573,183.00	6.41
114	688045	必易微	1,569,936.50	6.39
115	300862	蓝盾光电	1,564,980.00	6.37
116	300839	博汇股份	1,564,144.00	6.37
117	688618	三旺通信	1,535,357.47	6.25
118	301392	汇成真空	1,534,708.00	6.25
119	300855	图南股份	1,531,529.00	6.24
120	688395	正弦电气	1,527,896.46	6.22
121	603657	春光科技	1,519,535.00	6.19
122	300314	戴维医疗	1,512,073.00	6.16
123	300401	花园生物	1,503,751.00	6.12
124	688681	科汇股份	1,500,849.71	6.11
125	603191	望变电气	1,491,775.00	6.08
126	301033	迈普医学	1,491,403.00	6.07
127	300428	立中集团	1,481,845.00	6.04
128	300680	隆盛科技	1,475,380.00	6.01
129	688175	高凌信息	1,474,596.12	6.01
130	688571	杭华股份	1,458,352.80	5.94
131	300806	斯迪克	1,440,646.00	5.87
132	301196	唯科科技	1,433,951.00	5.84
133	300715	凯伦股份	1,429,756.00	5.82
134	605358	立昂微	1,420,067.00	5.78
135	688359	三孚新科	1,419,055.09	5.78
136	603912	佳力图	1,416,028.00	5.77
137	002478	常宝股份	1,413,574.00	5.76
138	688060	云涌科技	1,411,584.02	5.75
139	002997	瑞鹄模具	1,408,146.00	5.74
140	603360	百傲化学	1,403,580.00	5.72
141	002992	宝明科技	1,400,535.00	5.70
142	688466	金科环境	1,398,249.24	5.69
143	300101	振芯科技	1,394,452.00	5.68
144	300217	东方电热	1,377,733.00	5.61
145	300816	艾可蓝	1,377,213.00	5.61
146	002860	星帅尔	1,369,150.31	5.58

147	300836	佰奥智能	1,368,915.00	5.58
148	301168	通灵股份	1,366,725.00	5.57
149	300893	松原安全	1,364,465.20	5.56
150	688377	迪威尔	1,362,396.73	5.55
151	300623	捷捷微电	1,358,021.00	5.53
152	300531	优博讯	1,357,658.00	5.53
153	300435	中泰股份	1,351,383.00	5.50
154	688148	芳源股份	1,346,525.71	5.48
155	300594	朗进科技	1,343,879.00	5.47
156	688560	明冠新材	1,340,437.28	5.46
157	300610	晨化股份	1,340,391.00	5.46
158	688058	宝兰德	1,336,747.56	5.44
159	300653	正海生物	1,336,562.00	5.44
160	603286	日盈电子	1,332,851.00	5.43
161	301367	瑞迈特	1,327,219.00	5.41
162	603350	安乃达	1,324,434.55	5.39
163	688096	京源环保	1,323,856.90	5.39
164	688659	元琛科技	1,321,337.05	5.38
165	688108	赛诺医疗	1,321,233.35	5.38
166	688468	科美诊断	1,318,281.81	5.37
167	688310	迈得医疗	1,299,548.89	5.29
168	688295	中复神鹰	1,295,434.10	5.28
169	688026	洁特生物	1,295,075.34	5.27
170	300545	联得装备	1,285,183.00	5.23
171	603324	盛剑科技	1,283,103.00	5.23
172	688391	钜泉科技	1,283,064.46	5.23
173	300613	富瀚微	1,280,523.00	5.22
174	688092	爱科科技	1,257,158.58	5.12
175	688323	瑞华泰	1,256,449.01	5.12
176	300200	高盟新材	1,254,210.00	5.11
177	300757	罗博特科	1,251,819.00	5.10
178	301456	盘古智能	1,245,399.00	5.07
179	002698	博实股份	1,245,012.00	5.07
180	301129	瑞纳智能	1,242,143.00	5.06
181	301338	凯格精机	1,239,951.00	5.05
182	002880	卫光生物	1,239,305.00	5.05
183	300853	申昊科技	1,233,298.00	5.02
184	301010	晶雪节能	1,232,445.00	5.02
185	300931	通用电梯	1,227,312.00	5.00
186	688355	明志科技	1,225,699.59	4.99
187	688448	磁谷科技	1,214,729.67	4.95
188	688129	东来技术	1,213,302.66	4.94
189	300882	万胜智能	1,212,262.00	4.94

190	002158	汉钟精机	1,205,130.00	4.91
191	605488	福莱新材	1,202,794.00	4.90
192	605111	新洁能	1,202,192.00	4.90
193	001309	德明利	1,198,059.00	4.88
194	688069	德林海	1,189,076.99	4.84
195	688383	新益昌	1,188,127.61	4.84
196	605376	博迁新材	1,181,278.00	4.81
197	300461	田中精机	1,178,307.00	4.80
198	603185	弘元绿能	1,158,865.00	4.72
199	002409	雅克科技	1,148,826.00	4.68
200	003017	大洋生物	1,146,815.20	4.67
201	300880	迦南智能	1,144,887.32	4.66
202	603809	豪能股份	1,142,455.00	4.65
203	688308	欧科亿	1,137,918.72	4.63
204	301548	崇德科技	1,137,709.75	4.63
205	300236	上海新阳	1,134,908.00	4.62
206	300980	祥源新材	1,134,875.00	4.62
207	003038	鑫铂股份	1,128,208.00	4.60
208	300706	阿石创	1,126,850.00	4.59
209	301349	信德新材	1,117,285.00	4.55
210	688598	金博股份	1,109,074.46	4.52
211	300661	圣邦股份	1,108,333.00	4.51
212	301323	新莱福	1,106,646.00	4.51
213	688141	杰华特	1,105,404.83	4.50
214	605166	聚合顺	1,104,278.00	4.50
215	300950	德固特	1,101,840.00	4.49
216	301002	崧盛股份	1,097,625.00	4.47
217	603119	浙江荣泰	1,090,309.00	4.44
218	301030	仕净科技	1,089,932.60	4.44
219	001269	欧晶科技	1,085,661.00	4.42
220	688496	清越科技	1,074,890.16	4.38
221	300172	中电环保	1,074,113.00	4.37
222	300606	金太阳	1,072,331.00	4.37
223	002119	康强电子	1,069,158.00	4.35
224	002054	德美化工	1,060,697.00	4.32
225	688478	晶升股份	1,053,452.73	4.29
226	688022	瀚川智能	1,049,102.39	4.27
227	002322	理工能科	1,040,652.00	4.24
228	605258	协和电子	1,032,581.00	4.21
229	603124	江南新材	1,025,536.00	4.18
230	003031	中瓷电子	1,025,016.00	4.17
231	603893	瑞芯微	1,020,422.00	4.16
232	301325	曼恩斯特	1,005,006.00	4.09

233	300976	达瑞电子	996,201.00	4.06
234	301550	斯菱智驱	991,124.00	4.04
235	300474	景嘉微	989,846.00	4.03
236	300480	光力科技	986,120.00	4.02
237	603826	坤彩科技	984,517.40	4.01
238	300672	国科微	981,118.00	4.00
239	300817	双飞集团	973,309.75	3.96
240	688558	国盛智科	971,944.36	3.96
241	688403	汇成股份	971,070.50	3.96
242	603960	克来机电	970,864.00	3.95
243	603256	宏和科技	966,667.00	3.94
244	300779	惠城环保	963,573.00	3.92
245	688267	中触媒	962,750.99	3.92
246	688576	西山科技	961,785.28	3.92
247	301413	安培龙	942,022.00	3.84
248	688669	聚石化学	938,691.68	3.82
249	300382	斯莱克	932,167.00	3.80
250	688314	康拓医疗	928,053.08	3.78
251	301383	天键股份	927,874.00	3.78
252	688143	长盈通	923,545.17	3.76
253	301150	中一科技	920,914.00	3.75
254	002927	泰永长征	912,022.00	3.71
255	688503	聚和材料	893,336.87	3.64
256	300982	苏文电能	892,439.00	3.63
257	001314	亿道信息	865,541.00	3.53
258	301536	星辰科技	865,369.00	3.52
259	301312	智立方	858,974.00	3.50
260	301611	珂玛科技	857,625.00	3.49
261	300762	上海瀚讯	844,788.00	3.44
262	688667	菱电电控	840,150.38	3.42
263	603728	鸣志电器	828,257.00	3.37
264	300587	天铁科技	823,814.00	3.36
265	300956	英力股份	823,726.60	3.35
266	300881	盛德鑫泰	823,012.00	3.35
267	300337	银邦股份	819,721.00	3.34
268	603375	盛景微	816,730.00	3.33
269	605399	晨光新材	812,794.00	3.31
270	301556	托普云农	812,280.00	3.31
271	300900	广联航空	811,681.00	3.31
272	002917	金奥博	811,414.00	3.30
273	688389	普门科技	801,519.63	3.26
274	688153	唯捷创芯	800,328.27	3.26
275	688191	智洋创新	798,935.89	3.25

276	605058	澳弘电子	796,999.00	3.25
277	688277	天智航	794,063.06	3.23
278	688435	英方软件	790,547.46	3.22
279	688020	方邦股份	786,470.45	3.20
280	688369	致远互联	785,634.93	3.20
281	002979	雷赛智能	777,368.00	3.17
282	688350	富淼科技	769,329.76	3.13
283	688651	盛邦安全	768,674.01	3.13
284	000920	沃顿科技	767,605.00	3.13
285	300213	佳讯飞鸿	759,911.00	3.10
286	688312	燕麦科技	751,154.26	3.06
287	301225	恒勃股份	745,108.00	3.03
288	301608	博实结	742,048.00	3.02
289	300818	耐普矿机	732,255.20	2.98
290	300035	中科电气	732,228.00	2.98
291	603516	淳中科技	730,469.00	2.98
292	300767	震安科技	726,487.00	2.96
293	300655	晶瑞电材	726,288.00	2.96
294	300493	润欣科技	720,359.00	2.93
295	002112	三变科技	718,489.00	2.93
296	688133	泰坦科技	716,697.30	2.92
297	603496	恒为科技	716,216.00	2.92
298	688210	统联精密	715,673.72	2.91
299	300484	蓝海华腾	696,600.00	2.84
300	688711	宏微科技	692,580.15	2.82
301	301160	翔楼新材	689,273.00	2.81
302	300548	长芯博创	686,680.00	2.80
303	301269	华大九天	683,116.00	2.78
304	300907	康平科技	674,577.00	2.75
305	001282	三联锻造	666,834.60	2.72
306	300354	东华测试	656,883.00	2.68
307	688046	药康生物	654,745.79	2.67
308	300241	瑞丰光电	652,880.00	2.66
309	688178	万德斯	648,135.24	2.64
310	002170	芭田股份	633,461.88	2.58
311	301600	慧翰股份	627,399.59	2.56
312	300398	飞凯材料	627,046.00	2.55
313	300971	博亚精工	613,002.00	2.50
314	688118	普元信息	608,124.87	2.48
315	688480	赛恩斯	607,987.66	2.48
316	300446	航天智造	603,858.00	2.46
317	688273	麦澜德	603,267.49	2.46
318	300346	南大光电	601,623.00	2.45

319	301362	民爆光电	598,492.00	2.44
320	300820	英杰电气	598,491.00	2.44
321	301179	泽宇智能	596,982.00	2.43
322	688625	呈和科技	594,454.91	2.42
323	301511	德福科技	593,292.00	2.42
324	300752	隆利科技	589,907.00	2.40
325	301000	肇民科技	582,104.94	2.37
326	688085	三友医疗	570,910.74	2.33
327	688007	光峰科技	567,633.72	2.31
328	300993	玉马科技	553,642.00	2.25
329	301389	隆扬电子	548,079.00	2.23
330	688699	明微电子	542,632.11	2.21
331	688661	和林微纳	537,708.87	2.19
332	300394	天孚通信	533,143.00	2.17
333	688209	英集芯	532,564.39	2.17
334	688335	复洁科技	531,746.93	2.17
335	688330	宏力达	530,828.60	2.16
336	301206	三元生物	528,279.00	2.15
337	688159	有方科技	522,351.83	2.13
338	300179	四方达	521,876.00	2.13
339	003026	中晶科技	517,957.80	2.11
340	688106	金宏气体	517,544.27	2.11
341	301128	强瑞技术	516,812.80	2.10
342	301095	广立微	508,169.00	2.07
343	300617	安靠智电	506,631.00	2.06
344	688112	鼎阳科技	502,193.89	2.05
345	688613	奥精医疗	497,787.55	2.03
346	300775	三角防务	497,484.00	2.03
347	603232	格尔软件	491,916.00	2.00

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	002825	纳尔股份	2,670,867.00	10.88
2	001332	锡装股份	2,626,368.00	10.70
3	605389	长龄液压	2,363,722.00	9.63
4	603681	永冠新材	2,315,099.00	9.43
5	605060	联德股份	2,302,522.00	9.38
6	002971	和远气体	2,265,063.00	9.23
7	300470	中密控股	2,104,657.00	8.57
8	301391	卡莱特	2,001,660.00	8.15
9	603722	阿科力	1,991,803.00	8.11
10	300876	蒙泰高新	1,971,860.02	8.03

11	603678	火炬电子	1,955,675.00	7.97
12	002545	东方铁塔	1,954,909.00	7.96
13	301080	百普赛斯	1,902,581.20	7.75
14	300360	炬华科技	1,892,358.00	7.71
15	603088	宁波精达	1,879,976.00	7.66
16	300839	博汇股份	1,874,414.00	7.63
17	603520	司太立	1,861,690.00	7.58
18	603966	法兰泰克	1,859,607.00	7.57
19	603192	汇得科技	1,843,605.00	7.51
20	002255	海陆重工	1,814,845.00	7.39
21	300508	维宏股份	1,807,655.00	7.36
22	300406	九强生物	1,776,559.00	7.24
23	002833	弘亚数控	1,776,135.00	7.23
24	688132	邦彦技术	1,773,574.87	7.22
25	300447	全信股份	1,766,221.00	7.19
26	300777	中简科技	1,756,203.00	7.15
27	300515	三德科技	1,742,478.00	7.10
28	300643	万通智控	1,717,162.00	6.99
29	002478	常宝股份	1,700,274.00	6.92
30	603786	科博达	1,700,251.00	6.92
31	300780	德恩精工	1,697,104.00	6.91
32	603098	森特股份	1,695,580.00	6.91
33	002983	芯瑞达	1,691,341.00	6.89
34	300236	上海新阳	1,677,675.00	6.83
35	603040	新坐标	1,671,773.02	6.81
36	301010	晶雪节能	1,653,263.00	6.73
37	300586	美联新材	1,646,814.20	6.71
38	301603	乔锋智能	1,626,743.00	6.63
39	603191	望变电气	1,616,222.00	6.58
40	603325	博隆技术	1,613,765.60	6.57
41	300685	艾德生物	1,609,622.00	6.56
42	300833	浩洋股份	1,600,115.10	6.52
43	300510	金冠股份	1,597,222.00	6.51
44	300404	博济医药	1,596,850.00	6.50
45	603004	鼎龙科技	1,588,856.00	6.47
46	300428	立中集团	1,560,143.00	6.35
47	002821	凯莱英	1,559,691.00	6.35
48	300385	雪浪环境	1,552,320.00	6.32
49	603109	神驰机电	1,552,110.00	6.32
50	688329	艾隆科技	1,550,728.34	6.32
51	300862	蓝盾光电	1,548,432.00	6.31
52	688156	路德科技	1,547,365.86	6.30
53	300909	汇创达	1,547,105.00	6.30

54	002993	奥海科技	1,546,254.00	6.30
55	688045	必易微	1,544,625.13	6.29
56	688618	三旺通信	1,541,807.12	6.28
57	688295	中复神鹰	1,528,943.66	6.23
58	603062	麦加芯彩	1,518,978.00	6.19
59	688060	云涌科技	1,506,334.25	6.14
60	300806	斯迪克	1,503,084.00	6.12
61	688058	宝兰德	1,482,123.88	6.04
62	301310	鑫宏业	1,479,578.00	6.03
63	688026	洁特生物	1,456,140.97	5.93
64	603657	春光科技	1,454,166.00	5.92
65	688623	双元科技	1,445,453.05	5.89
66	300855	图南股份	1,439,870.00	5.86
67	603938	三孚股份	1,436,673.40	5.85
68	603267	鸿远电子	1,434,026.00	5.84
69	300920	润阳科技	1,420,722.00	5.79
70	605123	派克新材	1,411,397.00	5.75
71	605358	立昂微	1,410,451.00	5.74
72	688395	正弦电气	1,400,260.58	5.70
73	605111	新洁能	1,397,929.00	5.69
74	300416	苏试试验	1,397,169.00	5.69
75	300314	戴维医疗	1,395,614.00	5.68
76	002158	汉钟精机	1,390,475.00	5.66
77	002903	宇环数控	1,387,185.00	5.65
78	688069	德林海	1,384,320.39	5.64
79	688681	科汇股份	1,376,408.14	5.61
80	605305	中际联合	1,370,670.00	5.58
81	688323	瑞华泰	1,354,917.76	5.52
82	001309	德明利	1,354,793.00	5.52
83	688308	欧科亿	1,339,139.69	5.45
84	688092	爱科科技	1,337,331.31	5.45
85	301196	唯科科技	1,329,943.00	5.42
86	300594	朗进科技	1,326,349.00	5.40
87	688148	芳源股份	1,322,679.18	5.39
88	300286	安科瑞	1,318,405.00	5.37
89	603041	美思德	1,318,139.00	5.37
90	301028	鼎熔岩	1,312,388.00	5.35
91	688391	钜泉科技	1,310,560.90	5.34
92	301278	快可电子	1,309,671.00	5.33
93	603115	海星股份	1,308,873.96	5.33
94	300893	松原安全	1,301,266.60	5.30
95	301175	中科环保	1,300,914.00	5.30
96	603725	天安新材	1,300,214.00	5.30

97	300217	东方电热	1,288,244.00	5.25
98	605116	奥锐特	1,285,632.00	5.24
99	003025	思进智能	1,284,995.20	5.23
100	301192	泰祥股份	1,283,583.00	5.23
101	300653	正海生物	1,278,722.00	5.21
102	300757	罗博特科	1,274,986.00	5.19
103	002996	顺博合金	1,268,106.00	5.16
104	002997	瑞鹄模具	1,266,297.00	5.16
105	301195	北路智控	1,265,427.00	5.15
106	002933	新兴装备	1,259,134.00	5.13
107	603350	安乃达	1,257,871.00	5.12
108	605016	百龙创园	1,256,071.90	5.12
109	300980	祥源新材	1,254,123.00	5.11
110	301367	瑞迈特	1,251,805.00	5.10
111	605183	确成股份	1,246,526.00	5.08
112	688560	明冠新材	1,241,835.29	5.06
113	001339	智微智能	1,233,685.00	5.02
114	002860	星帅尔	1,230,754.00	5.01
115	300200	高盟新材	1,228,443.00	5.00
116	301323	新莱福	1,215,741.00	4.95
117	002675	东诚药业	1,207,882.00	4.92
118	300715	凯伦股份	1,187,702.40	4.84
119	603912	佳力图	1,186,052.00	4.83
120	300816	艾可蓝	1,179,954.00	4.81
121	688359	三孚新科	1,175,344.51	4.79
122	300488	恒锋工具	1,172,872.00	4.78
123	300706	阿石创	1,165,604.00	4.75
124	605488	福莱新材	1,164,717.00	4.74
125	688355	明志科技	1,163,491.09	4.74
126	605166	聚合顺	1,161,580.00	4.73
127	603324	盛剑科技	1,158,357.00	4.72
128	300926	博俊科技	1,148,522.00	4.68
129	300401	花园生物	1,145,543.00	4.67
130	688468	科美诊断	1,142,074.60	4.65
131	002057	中钢天源	1,132,698.00	4.61
132	688558	国盛智科	1,131,968.98	4.61
133	301397	溯联股份	1,126,266.10	4.59
134	688448	磁谷科技	1,125,091.16	4.58
135	300942	易瑞生物	1,124,962.00	4.58
136	688576	西山科技	1,124,699.82	4.58
137	301266	宇邦新材	1,119,108.00	4.56
138	002698	博实股份	1,109,016.00	4.52
139	301548	崇德科技	1,108,987.00	4.52

140	688350	富淼科技	1,106,176.36	4.51
141	688571	杭华股份	1,105,373.34	4.50
142	300305	裕兴股份	1,100,973.00	4.48
143	300809	华辰装备	1,100,243.00	4.48
144	300916	朗特智能	1,098,839.00	4.48
145	688314	康拓医疗	1,098,818.47	4.48
146	300190	维尔利	1,092,759.00	4.45
147	300610	晨化股份	1,090,992.00	4.44
148	002747	埃斯顿	1,082,262.00	4.41
149	688377	迪威尔	1,080,860.62	4.40
150	688669	聚石化学	1,079,673.37	4.40
151	300590	移为通信	1,077,237.00	4.39
152	301119	正强股份	1,072,876.00	4.37
153	688129	东来技术	1,068,708.58	4.35
154	301283	聚胶股份	1,067,082.00	4.35
155	002409	雅克科技	1,065,947.00	4.34
156	301150	中一科技	1,059,950.40	4.32
157	688335	复洁科技	1,059,567.95	4.32
158	002006	精工科技	1,059,548.65	4.32
159	603809	豪能股份	1,056,345.40	4.30
160	002880	卫光生物	1,050,656.00	4.28
161	300435	中泰股份	1,021,534.00	4.16
162	688022	瀚川智能	1,017,105.63	4.14
163	001223	欧克科技	1,015,679.00	4.14
164	300371	汇中股份	1,010,628.00	4.12
165	605399	晨光新材	1,009,106.00	4.11
166	603960	克来机电	1,004,428.00	4.09
167	688478	晶升股份	998,694.86	4.07
168	002970	锐明技术	998,163.00	4.07
169	301456	盘古智能	998,150.00	4.07
170	002876	三利谱	982,832.00	4.00
171	603281	江瀚新材	979,197.00	3.99
172	688371	菲沃泰	979,187.70	3.99
173	688178	万德斯	972,892.84	3.96
174	300172	中电环保	972,270.00	3.96
175	002927	泰永长征	970,041.00	3.95
176	300474	景嘉微	967,094.00	3.94
177	300680	隆盛科技	958,711.00	3.90
178	688369	致远互联	956,679.03	3.90
179	002779	中坚科技	956,384.60	3.90
180	003038	鑫铂股份	955,444.00	3.89
181	300035	中科电气	954,256.00	3.89
182	300779	惠城环保	950,614.00	3.87

183	603185	弘元绿能	943,690.00	3.84
184	002829	星网宇达	941,236.00	3.83
185	300762	上海瀚讯	941,209.54	3.83
186	300480	光力科技	931,467.00	3.79
187	603489	八方股份	922,474.55	3.76
188	688667	菱电电控	917,666.61	3.74
189	300587	天铁科技	916,710.00	3.73
190	003031	中瓷电子	915,331.00	3.73
191	688210	统联精密	913,343.74	3.72
192	688310	迈得医疗	912,942.37	3.72
193	688143	长盈通	909,777.00	3.71
194	688175	高凌信息	890,838.24	3.63
195	688503	聚和材料	886,464.73	3.61
196	688659	元琛科技	879,768.30	3.58
197	605167	利柏特	876,469.00	3.57
198	300817	双飞集团	865,584.00	3.53
199	603826	坤彩科技	859,836.50	3.50
200	300993	玉马科技	859,036.00	3.50
201	688496	清越科技	859,027.08	3.50
202	688267	中触媒	858,670.29	3.50
203	002810	山东赫达	855,388.00	3.48
204	301033	迈普医学	852,956.00	3.47
205	300337	银邦股份	845,972.00	3.45
206	002947	恒铭达	844,541.00	3.44
207	300545	联得装备	836,251.00	3.41
208	603516	淳中科技	832,004.00	3.39
209	603203	快克智能	828,111.00	3.37
210	301383	天键股份	826,791.11	3.37
211	688383	新益昌	825,740.95	3.36
212	301392	汇成真空	823,711.00	3.35
213	688403	汇成股份	821,417.48	3.35
214	688020	方邦股份	820,052.58	3.34
215	603950	长源东谷	817,878.00	3.33
216	001205	盛航股份	815,473.00	3.32
217	002979	雷赛智能	815,063.00	3.32
218	688273	麦澜德	812,964.55	3.31
219	002992	宝明科技	809,874.00	3.30
220	688480	赛恩斯	809,158.48	3.30
221	300414	中光防雷	801,999.00	3.27
222	301413	安培龙	801,431.00	3.26
223	688330	宏力达	791,324.17	3.22
224	300900	广联航空	790,807.00	3.22
225	300881	盛德鑫泰	783,020.00	3.19

226	300655	晶瑞电材	781,897.00	3.18
227	688651	盛邦安全	780,420.85	3.18
228	688133	泰坦科技	780,414.63	3.18
229	002587	奥拓电子	775,559.00	3.16
230	603728	鸣志电器	770,615.00	3.14
231	300548	长芯博创	769,293.00	3.13
232	301550	斯菱智驱	768,141.48	3.13
233	301325	曼恩斯特	761,361.00	3.10
234	002774	快意电梯	761,004.00	3.10
235	300956	英力股份	759,952.00	3.10
236	688108	赛诺医疗	754,751.90	3.07
237	300382	斯莱克	752,704.00	3.07
238	300882	万胜智能	748,047.00	3.05
239	688312	燕麦科技	747,026.01	3.04
240	688466	金科环境	744,276.34	3.03
241	688711	宏微科技	743,902.16	3.03
242	603256	宏和科技	742,338.00	3.02
243	002324	普利特	741,898.00	3.02
244	300101	振芯科技	738,160.00	3.01
245	002119	康强电子	736,047.00	3.00
246	301556	托普云农	731,903.46	2.98
247	300853	申昊科技	730,522.00	2.98
248	300623	捷捷微电	727,348.00	2.96
249	300767	震安科技	717,796.00	2.92
250	002112	三变科技	714,428.00	2.91
251	603360	百傲化学	714,325.00	2.91
252	603893	瑞芯微	708,429.00	2.89
253	001282	三联锻造	708,361.80	2.89
254	300484	蓝海华腾	705,858.00	2.87
255	300346	南大光电	705,720.00	2.87
256	301600	慧翰股份	699,394.38	2.85
257	300880	迦南智能	694,913.00	2.83
258	300531	优博讯	693,591.00	2.82
259	301611	珂玛科技	690,990.00	2.81
260	688106	金宏气体	688,703.56	2.80
261	603375	盛景微	687,545.00	2.80
262	301210	金杨精密	687,376.00	2.80
263	688257	新锐股份	686,098.66	2.79
264	300613	富瀚微	685,849.00	2.79
265	300971	博亚精工	684,459.80	2.79
266	300213	佳讯飞鸿	684,155.00	2.79
267	603701	德宏股份	682,761.00	2.78
268	301280	珠城科技	673,113.20	2.74

269	301312	智立方	672,243.20	2.74
270	688598	金博股份	665,057.16	2.71
271	300950	德固特	658,485.00	2.68
272	301007	德迈仕	657,682.00	2.68
273	300179	四方达	655,620.00	2.67
274	300606	金太阳	655,467.00	2.67
275	300493	润欣科技	652,895.12	2.66
276	300820	英杰电气	649,013.00	2.64
277	301206	三元生物	645,073.00	2.63
278	001269	欧晶科技	641,524.00	2.61
279	301128	强瑞技术	629,926.56	2.57
280	301168	通灵股份	627,284.00	2.55
281	301030	仕净科技	624,435.00	2.54
282	301095	广立微	617,550.00	2.52
283	688319	欧林生物	616,870.76	2.51
284	300982	苏文电能	604,917.60	2.46
285	688085	三友医疗	603,423.33	2.46
286	301269	华大九天	603,193.00	2.46
287	001306	夏厦精密	594,200.00	2.42
288	300354	东华测试	576,309.00	2.35
289	688112	鼎阳科技	571,503.18	2.33
290	300672	国科微	569,067.00	2.32
291	300398	飞凯材料	568,253.00	2.31
292	603286	日盈电子	568,126.00	2.31
293	300617	安靠智电	564,653.00	2.30
294	300446	航天智造	558,736.00	2.28
295	301389	隆扬电子	555,440.00	2.26
296	688699	明微电子	548,337.18	2.23
297	301377	鼎泰高科	547,513.00	2.23
298	603232	格尔软件	546,359.00	2.23
299	301511	德福科技	542,751.00	2.21
300	301349	信德新材	540,483.13	2.20
301	300836	佰奥智能	523,678.95	2.13
302	301261	恒工精密	503,785.00	2.05
303	688328	深科达	502,327.19	2.05
304	002322	理工能科	497,662.00	2.03
305	688613	奥精医疗	497,644.16	2.03
306	688389	普门科技	495,256.31	2.02

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	545,237,016.52
卖出股票收入（成交）总额	438,915,918.44

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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	73,959.85
2	应收清算款	93,913.37
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	3,224,343.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,392,216.72

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	1,704	28,081.18	11,319,140.60	23.66	36,531,192.00	76.34
银华专精特新量化 优选股票 发起式 C	5,203	15,743.50	46,402,907.81	56.65	35,510,509.29	43.35
合计	6,907	18,787.28	57,722,048.41	44.48	72,041,701.29	55.52

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	银华专精特新量化优选股票	183,330.14	0.38

有从业人员持有本基金	发起式 A		
	银华专精特新量化优选股票发起式 C	420,342.23	0.51
	合计	603,672.37	0.47

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银华专精特新量化优选股票发起式 A	0~10
	银华专精特新量化优选股票发起式 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	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	-

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	7.71	10,002,000.20	7.71	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	7.71	10,002,000.20	7.71	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	19,504,356.01	5,577,655.64
本报告期基金总申购份额	85,028,181.33	319,536,102.85
减：本报告期基金总赎回份额	56,682,204.74	243,200,341.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,850,332.60	81,913,417.10

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

2025 年 4 月 26 日，本基金管理人发布关于公司副总经理任职的公告，徐波先生自 2025 年 4 月 24 日起担任本基金管理人副总经理职务。

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容诚会计师事务所（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 40,000.00 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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 (%)	
中信证券	2	201,699,127.26	20.51	89,937.97	20.51	-
广发证券	2	179,628,549.86	18.27	80,097.92	18.27	-
东方财富	5	132,914,239.80	13.52	59,267.16	13.52	-
浙商证券	2	123,830,308.82	12.59	55,216.09	12.59	-
兴业证券	1	88,704,032.57	9.02	39,553.48	9.02	-
国联民生证券	1	86,747,055.01	8.82	38,680.20	8.82	-
国泰海通	6	37,810,941.49	3.84	16,860.25	3.84	-
华西证券	2	30,855,465.77	3.14	13,758.26	3.14	-
东北证券	2	26,334,723.81	2.68	11,742.79	2.68	-
招商证券	1	23,650,694.88	2.40	10,546.05	2.40	-
东吴证券	2	18,140,423.94	1.84	8,089.25	1.84	-
国盛证券	2	15,643,514.73	1.59	6,975.09	1.59	-
信达证券	1	12,359,384.50	1.26	5,510.80	1.26	-
西南证券	3	5,112,422.11	0.52	2,279.75	0.52	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

国投证券	1	-	-	-	-	撤销 1个 交易 单元
国信证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	3	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择证券公司参与证券交易的标准为：（1）具备为公募基金提供交易服务、研究服务所需的业务资格。（2）财务状况良好，经营行为规范。（3）建立并具有健全的合规风控制度。（4）具有较强的交易服务能力、研究服务能力。

2、公司将参与证券交易的合作券商分为普通合作券商和重点合作券商两类。其中，普通合作券商应具备较强的交易服务能力；重点合作券商除需满足具备较强的交易服务能力要求外，还需具备较强的研究服务能力。

3、符合以上标准的证券公司可向公司提出准入申请，并按要求提交相关材料。公司对证券公司提交的材料依次开展初审评估、评审会评审及公司领导审批，通过评审及审批的证券公司方可获得证券交易参与资格。

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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

东方财富	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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 2024 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	2025 年 1 月 21 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 1 月 21 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金增聘基金经理的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2025 年 3 月 8 日
4	《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 (2025 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	2025 年 3 月 11 日
5	《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	2025 年 3 月 11 日
6	《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 (2025 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	2025 年 3 月 14 日
7	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 14 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于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离任的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 证券时报	2025 年 3 月 14 日
9	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 2024 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	2025 年 3 月 28 日
10	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 3 月 28 日
11	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 2025 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	2025 年 4 月 21 日
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 4 月 21 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通同一基金不同类别基金份额相互转换业务的公告》	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	2025 年 4 月 24 日
14	《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 (2025 年第 3 号)》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 9 日
15	《银华专精特新量化优选股票型发起	本基金管理人网站, 中	2025 年 5 月 9 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	
16	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 2025 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	2025 年 7 月 12 日
17	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 7 月 12 日
18	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 2025 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	2025 年 8 月 29 日
19	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 8 月 29 日
20	《银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金 2025 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	2025 年 10 月 27 日
21	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告》	四大证券报	2025 年 10 月 27 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	20250627-20250629	0.00	8,366,100.56	8,366,100.56	0.00	0.00
	2	20250701-20250714	0.00	28,699,200.32	28,699,200.32	0.00	0.00
	2	20250724-20250724	0.00	28,699,200.32	28,699,200.32	0.00	0.00
	2	20250729-20250729	0.00	28,699,200.32	28,699,200.32	0.00	0.00
	3	20250101-20250630	10,002,000.20	0.00	0.00	10,002,000.20	7.71

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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

2026 年 3 月 28 日