

# 银华食品饮料量化优选股票型发起式证券 投资基金

## 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1. 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	银华食品饮料量化优选股票发起式	
基金主代码	005235	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 9 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	120,244,679.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	银华食品饮料量化股票发起式 A	银华食品饮料量化股票发起式 C
下属分级基金的交易代码	005235	005236
报告期末下属分级基金的份额总额	61,724,237.24 份	58,520,441.86 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金综合使用多种量化选股策略，重点投资于食品饮料主题相关的上市公司，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金投资于食品饮料主题，使用主动量化策略对食品饮料主题界定内的股票进行筛选并进行权重的优化，力争在跟踪食品饮料主题整体市场表现的同时，获得相对于业绩比较基准的超额收益。本基金债券投资的主要目的是风险防御及现金替代性管理。债券投资将坚持安全性、流动性和收益性作为资产配置原则，采取久期调整策略、类属配置策略、收益率曲线策略，以兼顾投资组合的安全性、收益性与流动性。本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。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%；投资于食品饮料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%；每个交易日日终在扣除股指期货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、应收申购款等。
业绩比较基准	中证食品饮料指数收益率 $\times$ 90% + 商业银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 10%
风险收益特征	本基金属于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。

### 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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.yhfund.com.cn">http://www.yhfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日 – 2025 年 6 月 30 日)	
	银华食品饮料量化股票发起式 A	银华食品饮料量化股票发起式 C
本期已实现收益	-4,561,074.93	-7,367,008.54
本期利润	-4,418,356.21	-7,802,721.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0686	-0.0912
本期加权平均净值利润率	-3.88%	-5.25%
本期基金份额净值增长率	-3.63%	-3.82%
3.1.2 期末数	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

据和指标			
期末可供分配利润	4,275,316.00		1,735,711.25
期末可供分配基金份额利润	0.0693		0.0297
期末基金资产净值	106,182,531.67		98,206,679.34
期末基金份额净值	1.7203		1.6782
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
基金份额累计净值增长率	72.03%		67.82%

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

银华食品饮料量化股票发起式 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
过去一个月	-3.62%	0.79%	-4.72%	0.71%	1.10%	0.08%
过去三个月	-4.35%	0.97%	-4.35%	0.95%	0.00%	0.02%
过去六个月	-3.63%	1.07%	-5.94%	1.03%	2.31%	0.04%
过去一年	4.26%	1.68%	2.25%	1.59%	2.01%	0.09%
过去三年	-32.91%	1.45%	-34.39%	1.36%	1.48%	0.09%
自基金合同生效起至今	72.03%	1.63%	37.66%	1.54%	34.37%	0.09%

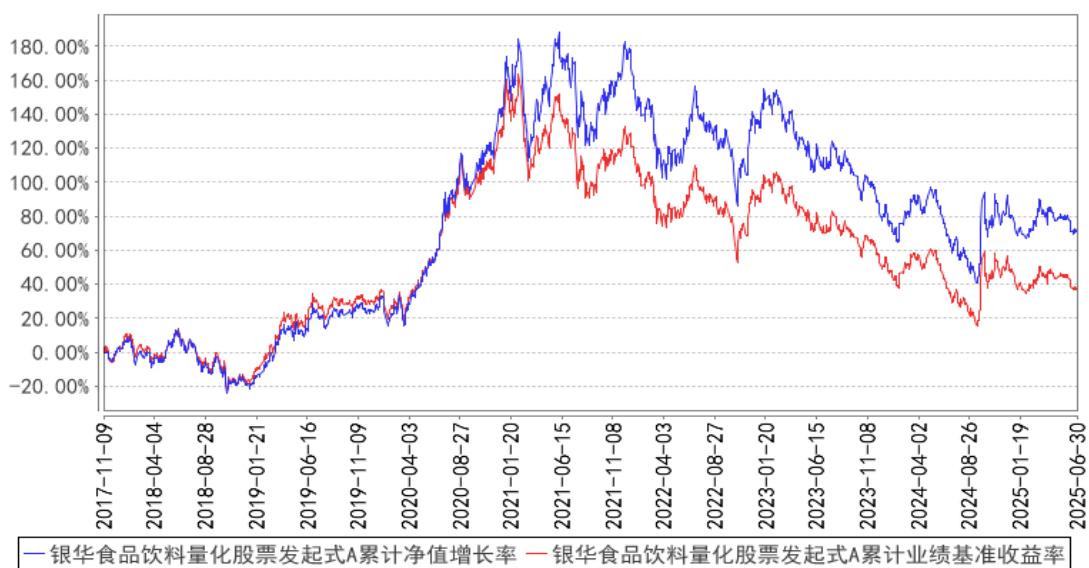
银华食品饮料量化股票发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

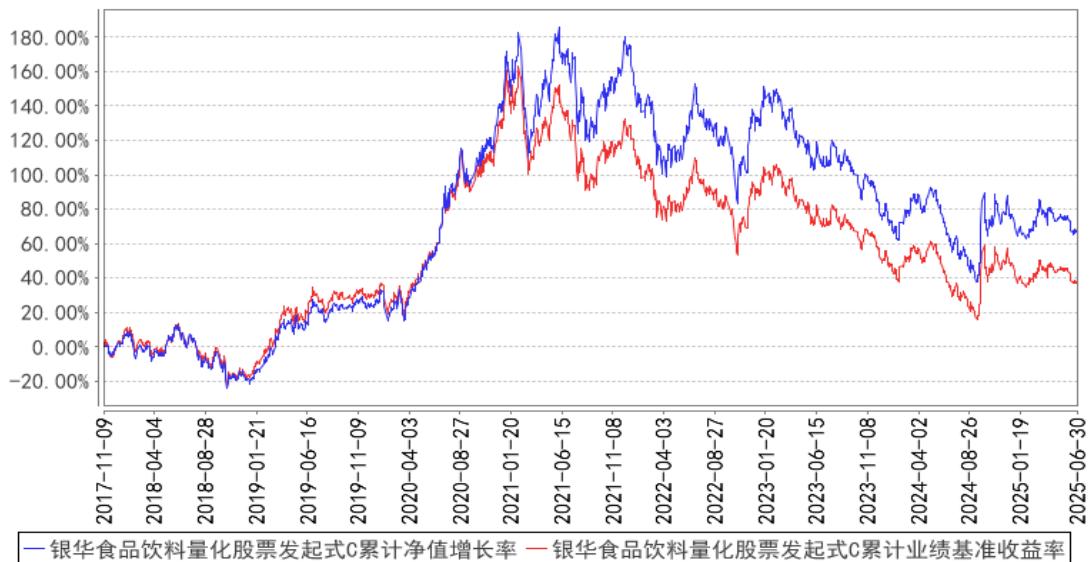
过去一个月	-3.65%	0.79%	-4.72%	0.71%	1.07%	0.08%
过去三个月	-4.45%	0.97%	-4.35%	0.95%	-0.10%	0.02%
过去六个月	-3.82%	1.07%	-5.94%	1.03%	2.12%	0.04%
过去一年	3.85%	1.68%	2.25%	1.59%	1.60%	0.09%
过去三年	-33.72%	1.45%	-34.39%	1.36%	0.67%	0.09%
自基金合同生效起至今	67.82%	1.63%	37.66%	1.54%	30.16%	0.09%

### 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

银华食品饮料量化股票发起式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图



银华食品饮料量化股票发起式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%；投资于食品饮料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%；每个交易日日终在扣除股指期货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、应收申购款等。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理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 年上半年，银华基金管理公募基金 227 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		
李宜璇 女士	本基金的 基金经理	2020 年 10 月 29 日	-	11 年	博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014 年 12 月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部总监助理/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日起兼任银华中证港股通高股息投资交易型开放式指数证
--	--	--	--	---

					券投资基金基金经理，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。
杨腾先生	本基金的基金经理	2021 年 11 月 29 日	-	12.5 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。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。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、《银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合不存在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。

## 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

上半年中，国内外宏观经济运行呈现出一些新的特点。国内方面，整体经济格局依然延续弱复苏的态势。在消费品国补等政策支撑下，内需消费稳健。此外，上半年经济中出现了一些新的亮点，如 AI、传媒、新消费等新兴行业都出现了热度持久的产品。海外方面，关税战给全球贸易带来了明显的不确定性，全球风险偏好在上半年出现了较大幅度的波动，避险情绪上升。在上述因素的作用下，上半年 A 股市场呈现波动后修复的特征，上证指数、中证 500、创业板指等宽基指数获得正收益。行业层面，有色金属、银行等行业表现领先，煤炭、房地产等行业表现相对落后。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华食品饮料量化股票发起式 A 基金份额净值为 1.7203 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.63%；截至本报告期末银华食品饮料量化股票发起式 C 基金份额净值为 1.6782 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.82%；业绩比较基准收益率为-5.94%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们仍然维持之前的观点。我们认为经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生，我们正处于这样的进程中，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、全球关税冲突、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》、《证券投资基金管理核算业务指引》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历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对银华基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6. 4. 7. 1	14,521,667.01	17,053,585.03
结算备付金		444,572.26	343,951.94
存出保证金		81,758.68	40,965.86
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	191,266,243.11	210,222,183.77
其中：股票投资		191,266,243.11	210,222,183.77
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	—	—
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	—	—
债权投资	6. 4. 7. 5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6. 4. 7. 6	—	—
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	—	—
应收清算款		—	11,786.56
应收股利		—	—
应收申购款		324,581.54	236,725.80
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 8	—	—
资产总计		206,638,822.60	227,909,198.96
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		—	—
应付赎回款		1,604,342.23	1,340,048.59

应付管理人报酬		182,352.41	194,397.26
应付托管费		18,235.23	19,439.72
应付销售服务费		37,358.42	35,099.83
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.9	407,323.30	298,648.19
负债合计		2,249,611.59	1,887,633.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	120,244,679.10	127,943,765.11
其他综合收益	6.4.7.11	—	—
未分配利润	6.4.7.12	84,144,531.91	98,077,800.26
净资产合计		204,389,211.01	226,021,565.37
负债和净资产总计		206,638,822.60	227,909,198.96

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，银华食品饮料量化股票发起式 A 基金份额净值 1.7203 元，基金份额总额 61,724,237.24 份；银华食品饮料量化股票发起式 C 基金份额净值 1.6782 元，基金份额总额 58,520,441.86 份。银华食品饮料量化优选股票发起式份额总额合计为 120,244,679.10 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华食品饮料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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业收入</b>		-10,403,879.62	-27,934,341.51
1. 利息收入		42,636.54	39,417.69
其中：存款利息收入	6.4.7.13	42,636.54	39,417.69
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）		-10,646,584.79	-33,758,423.69
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-14,582,977.64	-37,488,096.92
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.15	—	—

资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	-	-
股利收益	6. 4. 7. 19	3, 936, 392. 85	3, 729, 673. 23
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-292, 994. 10	5, 720, 252. 76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	493, 062. 73	64, 411. 73
<b>减：二、营业总支出</b>		1, 817, 197. 95	1, 786, 561. 80
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 304, 370. 49	1, 316, 218. 48
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	130, 437. 02	131, 621. 76
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	295, 905. 28	251, 806. 79
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	86, 485. 16	86, 914. 77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-12, 221, 077. 57	-29, 720, 903. 31
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-12, 221, 077. 57	-29, 720, 903. 31
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-12, 221, 077. 57	-29, 720, 903. 31

### 6.3 净资产变动表

会计主体：银华食品饮料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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计	

一、上期期末净资产	127,943,765.11	-	98,077,800.26	226,021,565.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	127,943,765.11	-	98,077,800.26	226,021,565.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-7,699,086.01	-	-13,933,268.35	-21,632,354.36
(一)、综合收益总额	-	-	-12,221,077.57	-12,221,077.57
(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)	-7,699,086.01	-	-1,712,190.78	-9,411,276.79
其中：1. 基金申购款	171,953,159.84	-	131,719,590.54	303,672,750.38
2. 基金赎回款	-179,652,245.85	-	-133,431,781.32	-313,084,027.17
(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	120,244,679.10	-	84,144,531.91	204,389,211.01
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	153,102,761.46	-	129,983,935.36	283,086,696.82
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	153,102,761.46	-	129,983,935.36	283,086,696.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,901,021.20	-	-43,594,639.51	-60,495,660.71
(一)、综合收益总额	-	-	-29,720,903.31	-29,720,903.31
(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)	-16,901,021.20	-	-13,873,736.20	-30,774,757.40
其中：1. 基金申购款	29,109,371.69	-	23,596,761.30	52,706,132.99
2. 基金赎回款	-46,010,392.89	-	-37,470,497.50	-83,480,890.39
(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	136,201,740.26	-	86,389,295.85	222,591,036.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

伍军辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2017]1072号《关于准予银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金注册的批复》的注册,由银华基金管理股份有限公司于2017年

10月16日至2017年11月3日向社会公开募集，基金合同于2017年11月9日生效，首次设立募集规模为13,526,775.40份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均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。

本基金根据所收取的认购费用、申购费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为A类和C类不同的类别。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。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板股票、创业板股票、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债券、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、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、非金融企业债务融资工具、银行存款（包括定期存款和协议存款及其他银行存款）、金融衍生品（股指期货等）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%；投资于食品饮料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%；每个交易日日终在扣除股指期货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、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。待基金投资其他品种的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致，并在履行适当程序后，参与该类业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时，基金投资其他品种的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项，将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。业绩比较基准：中证食品饮料指数收益率×90%+商业银行人民币活期存款利率（税后）×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编

报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金管理政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	14,521,667.01
等于： 本金	14,520,159.30
加： 应计利息	1,507.71
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	14,521,667.01

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	209,381,069.60	-	191,266,243.11	-18,114,826.49
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	209,381,069.60	-	191,266,243.11	-18,114,826.49

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

### 6.4.7.8 其他资产

注：无。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	391.04
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	280,109.40
其中：交易所市场	280,109.40
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	126,822.86
合计	407,323.30

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

银华食品饮料量化股票发起式 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	69,011,344.93	69,011,344.93
本期申购	7,506,063.68	7,506,063.68
本期赎回(以“-”号填列)	-14,793,171.37	-14,793,171.37
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	61,724,237.24	61,724,237.24
-----	---------------	---------------

## 银华食品饮料量化股票发起式 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	58,932,420.18	58,932,420.18
本期申购	164,447,096.16	164,447,096.16
本期赎回(以“-”号填列)	-164,859,074.48	-164,859,074.48
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	58,520,441.86	58,520,441.86

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

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 银华食品饮料量化股票发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,512,647.07	44,668,913.47	54,181,560.54
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,512,647.07	44,668,913.47	54,181,560.54
本期利润	-4,561,074.93	142,718.72	-4,418,356.21
本期基金份额交易产生的变动数	-676,256.14	-4,628,653.76	-5,304,909.90
其中：基金申购款	697,048.72	5,154,519.11	5,851,567.83
基金赎回款	-1,373,304.86	-9,783,172.87	-11,156,477.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,275,316.00	40,182,978.43	44,458,294.43

## 银华食品饮料量化股票发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,896,289.77	37,999,949.95	43,896,239.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,896,289.77	37,999,949.95	43,896,239.72
本期利润	-7,367,008.54	-435,712.82	-7,802,721.36
本期基金份额交易产	3,206,430.02	386,289.10	3,592,719.12

生的变动数			
其中：基金申购款	9,529,973.04	116,338,049.67	125,868,022.71
基金赎回款	-6,323,543.02	-115,951,760.57	-122,275,303.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,735,711.25	37,950,526.23	39,686,237.48

#### 6.4.7.13 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	41,492.59
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	1,027.54
其他	116.41
合计	42,636.54

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,582,977.64
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	-14,582,977.64

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	466,430,343.02
减：卖出股票成本总额	480,307,370.20
减：交易费用	705,950.46
买卖股票差价收入	-14,582,977.64

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：无。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,936,392.85
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	3,936,392.85

**6.4.7.20 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 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-292,994.10
股票投资	-292,994.10
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-292,994.10

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	488,540.45
基金转换费收入	4,522.28
合计	493,062.73

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：无。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行费用	4,662.30
合计	86,485.16

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
银华基金管理股份有限公司（“银华基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,304,370.49	1,316,218.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	500,914.19	497,405.59
应支付基金管理人的净管理费	803,456.30	818,812.89

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	130,437.02	131,621.76

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联 方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华食品饮料量化股 票发起式 A	银华食品饮料量化股 票发起式 C	合计

第一创业	-	16.27	16.27
西南证券	-	622.63	622.63
银华基金	-	11,559.19	11,559.19
中国工商银行	-	24,622.97	24,622.97
合计	-	36,821.06	36,821.06
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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华食品饮料量化股票发起式 A	银华食品饮料量化股票发起式 C	合计
第一创业	-	16.78	16.78
西南证券	-	761.66	761.66
银华基金	-	21,995.68	21,995.68
中国工商银行	-	27,334.73	27,334.73
合计	-	50,108.85	50,108.85

注：基金销售服务费每日计提，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 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	银华食品饮料量化股票发起式 A
基金合同生效日 ( 2017 年 11 月 9 日) 持有的基 金份额	—	—
报告期初持有的 基金份额	10,003,000.30	—
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	10,003,000.30	—
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	16.21%	—
项目	上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	银华食品饮料量化股票发起式 C
基金合同生效日 ( 2017 年 11 月 9 日) 持有的基 金份额	—	—
报告期初持有的 基金份额	10,003,000.30	—
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	10,003,000.30	—
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	13.64%	—

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

2、对于分级基金，下属分级份额的比例的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	14,521,667.01	41,492.59	20,069,891.29	36,679.85

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
001335	信凯科技	2025年4月2日	6个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025年1月16日	6个月	新股流通受限	5.30	14.44	602	3,190.60	8,692.88	-
001382	新亚电缆	2025年3月13日	6个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-

001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	182	5,005.00	10,226.58	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	666	6,926.40	22,717.26	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	156	4,650.90	12,147.72	锁定期送股/转股
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	194	5,349.28	8,772.68	锁定期送股/转股
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-

301590	优优 绿能	2025 年5月 28日	6 个月	新股 流通 受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太 力 科 技	2025 年5月 12日	6 个月	新股 流通 受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠 通 科 技	2025 年1月 8日	6 个月	新股 流通 受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超 研 股 份	2025 年1月 15日	6 个月	新股 流通 受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽 润 新 能	2025 年4月 30日	6 个月	新股 流通 受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首 航 新 能	2025 年3月 26日	6 个月	新股 流通 受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏 工 科 技	2025 年4月 10日	6 个月	新股 流通 受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰 禾 股 份	2025 年4月 2日	6 个月	新股 流通 受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新 恒 汇	2025 年6月 13日	6 个月	新股 流通 受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威 高 血 净	2025 年5月 12日	6 个月	新股 流通 受限	26.50	32.68	170	4,505.00	5,555.60	-
603049	中 策 橡 胶	2025 年5月 27日	6 个月	新股 流通 受限	46.50	42.85	184	8,556.00	7,884.40	-
603120	肯	2025	6 个月	新股	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

	特 催 化	年4月 9日		流通 受限						
603124	江南新材	2025 年3月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年4月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	93.50	90.66	53	4,955.50	4,804.98	-
603210	泰鸿万立	2025 年4月 1日	6 个月	新股 流通 受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年3月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年3月 4日	6 个月	新股 流通 受限	20.60	35.08	97	1,998.20	3,402.76	-
603382	海阳科技	2025 年6月 5日	6 个月	新股 流通 受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年6月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年2月 25 日	6 个月	新股 流通 受限	24.18	33.32	79	1,910.22	2,632.28	-
688757	胜科纳米	2025 年3月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线。在董事会领导下，董事会风险控制委员会定期听取审阅公司风险管理报告及相关情况，掌握公司的总体风险状况，确保风险控制与业务发展同步进行；公司总经理负责，由公司投资决策委员会和公司总经理及副总经理组成的经营管理层，通过风险管理部，对各项业务风险状况进行监督并及时制定相对应策和实施控制措施；由各部门总监负责，部门全员参与，根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程及风险控制措施，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,521,667.01	-	-	-	14,521,667.01
结算备付金	444,572.26	-	-	-	444,572.26
存出保证金	81,758.68	-	-	-	81,758.68
交易性金融资产	-	-	-191,266,243.11	191,266,243.11	
应收申购款	-	-	-	324,581.54	324,581.54

资产总计	15,047,997.95	-	-	191,590,824.65	206,638,822.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,604,342.23	1,604,342.23
应付管理人报酬	-	-	-	182,352.41	182,352.41
应付托管费	-	-	-	18,235.23	18,235.23
应付销售服务费	-	-	-	37,358.42	37,358.42
其他负债	-	-	-	407,323.30	407,323.30
负债总计	-	-	-	2,249,611.59	2,249,611.59
利率敏感度缺口	15,047,997.95	-	-	189,341,213.06	204,389,211.01
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	17,053,585.03	-	-	-	17,053,585.03
结算备付金	343,951.94	-	-	-	343,951.94
存出保证金	40,965.86	-	-	-	40,965.86
交易性金融资产	-	-	-	210,222,183.77	210,222,183.77
应收申购款	-	-	-	236,725.80	236,725.80
应收清算款	-	-	-	11,786.56	11,786.56
资产总计	17,438,502.83	-	-	210,470,696.13	227,909,198.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,340,048.59	1,340,048.59
应付管理人报酬	-	-	-	194,397.26	194,397.26
应付托管费	-	-	-	19,439.72	19,439.72
应付销售服务费	-	-	-	35,099.83	35,099.83
其他负债	-	-	-	298,648.19	298,648.19
负债总计	-	-	-	1,887,633.59	1,887,633.59
利率敏感度缺口	17,438,502.83	-	-	208,583,062.54	226,021,565.37

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金持有的利率敏感性资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资

于上市交易的证券，所面临的其他价格风险包含单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，以及市场价格变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30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	191,266,243.11	93.58	210,222,183.77	93.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	191,266,243.11	93.58	210,222,183.77	93.01

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相对应变化带来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2025 年 6 月 30 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升	5,534,656.93	6,495,880.58

	5%		
业绩比较基准下降 5%		-5, 534, 656. 93	-6, 495, 880. 58

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	190, 990, 542. 27	209, 978, 775. 73
第二层次	15, 385. 54	-
第三层次	260, 315. 30	243, 408. 04
合计	191, 266, 243. 11	210, 222, 183. 77

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这

些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	191,266,243.11	92.56
	其中：股票	191,266,243.11	92.56
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	14,966,239.27	7.24
8	其他各项资产	406,340.22	0.20
9	合计	206,638,822.60	100.00

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	186,062,242.55	91.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,163,941.00	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	11,656.36	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	28,403.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	191,266,243.11	93.58

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	13,996	19,727,641.92	9.65
2	000858	五粮液	148,623	17,671,274.70	8.65
3	600887	伊利股份	580,300	16,178,764.00	7.92
4	000568	泸州老窖	133,311	15,117,467.40	7.40
5	600809	山西汾酒	76,698	13,528,760.22	6.62
6	603288	海天味业	245,302	9,544,700.82	4.67
7	605499	东鹏饮料	22,650	7,113,232.50	3.48
8	603369	今世缘	143,044	5,568,702.92	2.72
9	002304	洋河股份	75,726	4,888,113.30	2.39
10	000729	燕京啤酒	321,696	4,159,529.28	2.04
11	600600	青岛啤酒	52,996	3,681,102.16	1.80
12	000895	双汇发展	141,001	3,441,834.41	1.68
13	000596	古井贡酒	25,239	3,360,572.85	1.64
14	300972	万辰集团	16,200	2,919,888.00	1.43
15	300999	金龙鱼	88,000	2,598,640.00	1.27
16	300146	汤臣倍健	227,300	2,554,852.00	1.25
17	002461	珠江啤酒	218,400	2,465,736.00	1.21
18	603345	安井食品	29,300	2,356,306.00	1.15
19	603198	迎驾贡酒	58,452	2,304,762.36	1.13
20	002956	西麦食品	95,000	2,229,650.00	1.09
21	002507	涪陵榨菜	172,110	2,201,286.90	1.08
22	600737	中粮糖业	226,300	2,138,535.00	1.05
23	002568	百润股份	82,500	2,112,825.00	1.03
24	600298	安琪酵母	56,667	1,992,978.39	0.98
25	603589	口子窖	54,414	1,893,607.20	0.93
26	002626	金达威	91,500	1,872,090.00	0.92
27	600882	妙可蓝多	61,200	1,868,436.00	0.91

28	600132	重庆啤酒	32,403	1,785,405.30	0.87
29	000848	承德露露	187,100	1,708,223.00	0.84
30	603027	千禾味业	145,720	1,691,809.20	0.83
31	600073	光明肉业	222,900	1,645,002.00	0.80
32	603156	养元饮品	74,500	1,576,420.00	0.77
33	600559	老白干酒	89,600	1,500,800.00	0.73
34	603919	金徽酒	78,900	1,428,090.00	0.70
35	300973	立高食品	28,800	1,404,576.00	0.69
36	002847	盐津铺子	17,200	1,382,880.00	0.68
37	603866	桃李面包	237,977	1,285,075.80	0.63
38	002597	金禾实业	53,800	1,266,990.00	0.62
39	603719	良品铺子	101,100	1,228,365.00	0.60
40	600597	光明乳业	144,200	1,212,722.00	0.59
41	603043	广州酒家	77,400	1,205,892.00	0.59
42	002946	新乳业	62,600	1,175,002.00	0.57
43	300791	仙乐健康	35,910	855,017.10	0.42
44	002695	煌上煌	85,100	799,940.00	0.39
45	002840	华统股份	71,800	747,438.00	0.37
46	600872	中炬高新	39,096	742,824.00	0.36
47	002216	三全食品	63,510	703,055.70	0.34
48	002481	双塔食品	132,000	698,280.00	0.34
49	600059	古越龙山	59,300	646,963.00	0.32
50	600779	水井坊	14,100	601,224.00	0.29
51	300783	三只松鼠	21,400	580,154.00	0.28
52	603711	香飘飘	33,500	467,660.00	0.23
53	605179	一鸣食品	22,300	449,568.00	0.22
54	000860	顺鑫农业	28,600	444,730.00	0.22
55	300997	欢乐家	25,200	444,528.00	0.22
56	603777	来伊份	33,000	433,290.00	0.21
57	003000	劲仔食品	29,900	395,577.00	0.19
58	600305	恒顺醋业	43,500	336,255.00	0.16
59	605300	佳禾食品	21,900	306,819.00	0.15
60	300765	新诺威	5,300	273,957.00	0.13
61	601579	会稽山	13,100	260,821.00	0.13
62	002991	甘源食品	4,000	249,880.00	0.12
63	600197	伊力特	16,600	247,672.00	0.12
64	605089	味知香	9,738	241,891.92	0.12
65	605567	春雪食品	23,500	240,405.00	0.12
66	605339	南侨食品	14,500	239,395.00	0.12
67	605016	百龙创园	11,560	238,482.80	0.12
68	603755	日辰股份	9,100	237,692.00	0.12
69	605077	华康股份	14,600	236,228.00	0.12
70	603057	紫燕食品	10,800	236,088.00	0.12

71	603170	宝立食品	18,900	235,683.00	0.12
72	688089	嘉必优	8,471	213,045.65	0.10
73	600702	舍得酒业	4,000	205,600.00	0.10
74	600429	三元股份	44,600	201,146.00	0.10
75	605388	均瑶健康	24,300	200,232.00	0.10
76	603517	绝味食品	11,800	179,950.00	0.09
77	603020	爱普股份	16,600	152,388.00	0.07
78	001215	千味央厨	5,200	148,148.00	0.07
79	600199	金种子酒	3,200	34,560.00	0.02
80	603317	天味食品	2,900	32,248.00	0.02
81	301458	钧崴电子	666	22,717.26	0.01
82	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01
83	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
84	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
85	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
86	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
87	688721	龙图光罩	279	12,582.90	0.01
88	301479	弘景光电	156	12,147.72	0.01
89	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.01
90	001391	国货航	1,732	11,656.36	0.01
91	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
92	301275	汉朔科技	182	10,226.58	0.01
93	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
94	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
95	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
96	301501	恒鑫生活	194	8,772.68	0.00
97	001356	富岭股份	602	8,692.88	0.00
98	603697	有友食品	600	7,914.00	0.00
99	603049	中策橡胶	184	7,884.40	0.00
100	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
101	603194	中力股份	168	7,625.52	0.00
102	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
103	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
104	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
105	603014	威高血净	170	5,555.60	0.00
106	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
107	603202	天有为	53	4,804.98	0.00
108	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
109	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
110	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
111	603271	永杰新材	97	3,402.76	0.00
112	603062	麦加芯彩	77	3,385.69	0.00
113	001390	吉麒绒材	178	3,225.36	0.00

114	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
115	603409	汇通控股	79	2,632.28	0.00
116	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
117	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
118	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
119	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	28,637,584.00	12.67
2	600887	伊利股份	26,925,492.00	11.91
3	600809	山西汾酒	21,725,235.00	9.61
4	000858	五粮液	21,226,339.80	9.39
5	603288	海天味业	18,327,232.68	8.11
6	600519	贵州茅台	17,809,461.00	7.88
7	000596	古井贡酒	15,110,582.51	6.69
8	605499	东鹏饮料	13,147,866.30	5.82
9	002304	洋河股份	9,870,479.00	4.37
10	600600	青岛啤酒	9,401,147.00	4.16
11	603198	迎驾贡酒	8,190,867.00	3.62
12	600298	安琪酵母	7,737,067.00	3.42
13	000895	双汇发展	7,677,595.00	3.40
14	000729	燕京啤酒	7,649,128.12	3.38
15	603345	安井食品	6,805,035.80	3.01
16	603027	千禾味业	6,474,087.00	2.86
17	600737	中粮糖业	6,340,140.00	2.81
18	603589	口子窖	6,326,467.00	2.80
19	002507	涪陵榨菜	6,114,481.20	2.71
20	002568	百润股份	5,841,469.00	2.58
21	300999	金龙鱼	5,800,458.00	2.57
22	002840	华统股份	5,460,554.00	2.42
23	603369	今世缘	5,371,083.00	2.38
24	300146	汤臣倍健	5,313,061.00	2.35
25	600132	重庆啤酒	5,210,632.00	2.31
26	600872	中炬高新	5,129,235.00	2.27
27	002461	珠江啤酒	4,815,117.00	2.13
28	603043	广州酒家	4,692,945.00	2.08
29	600597	光明乳业	4,571,089.00	2.02

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000568	泸州老窖	24,545,931.00	10.86
2	600887	伊利股份	22,638,026.00	10.02
3	000858	五 粮 液	21,242,653.00	9.40
4	603198	迎驾贡酒	18,667,037.00	8.26
5	600519	贵州茅台	18,589,892.35	8.22
6	600809	山西汾酒	18,371,204.00	8.13
7	000596	古井贡酒	18,160,912.21	8.04
8	603369	今世缘	18,051,506.00	7.99
9	603288	海天味业	14,411,163.65	6.38
10	002461	珠江啤酒	11,515,956.00	5.10
11	605499	东鹏饮料	10,874,263.50	4.81
12	600600	青岛啤酒	10,321,083.00	4.57
13	000895	双汇发展	9,180,497.44	4.06
14	000729	燕京啤酒	8,315,058.00	3.68
15	600298	安琪酵母	7,895,857.52	3.49
16	002304	洋河股份	7,501,097.00	3.32
17	600132	重庆啤酒	7,007,860.00	3.10
18	002507	涪陵榨菜	5,964,779.10	2.64
19	002714	牧原股份	5,721,138.00	2.53
20	600872	中炬高新	5,690,790.00	2.52
21	603345	安井食品	5,483,120.00	2.43
22	603027	千禾味业	5,087,101.52	2.25
23	603156	养元饮品	5,030,553.00	2.23
24	603589	口子窖	5,021,589.00	2.22
25	002568	百润股份	4,822,452.00	2.13
26	600737	中粮糖业	4,775,862.00	2.11
27	600779	水井坊	4,762,452.00	2.11
28	600597	光明乳业	4,603,980.00	2.04

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	461,644,423.64
卖出股票收入（成交）总额	466,430,343.02

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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

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

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	81,758.68
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	324,581.54
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	406,340.22

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
银华食品饮料量化股票发起式 A	20,864	2,958.41	10,006,949.97	16.21	51,717,287.27	83.79
银华食品饮料量化股票发起式 C	19,324	3,028.38	312,729.12	0.53	58,207,712.74	99.47
合计	40,188	2,992.05	10,319,679.09	8.58	109,925,000.01	91.42

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	银华食品饮料量化股票发起式 A	166,337.12	0.27
	银华食品饮料量化股票发起式 C	58,248.59	0.10
	合计	224,585.71	0.19

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	银华食品饮料量化股票发起式 A	-
	银华食品饮料量化股票发起式 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	银华食品饮料量化股票发起式 A	10~50
	银华食品饮料量化股票发起式 C	-
	合计	10~50

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,003,000.30	8.32	10,003,000.30	8.32	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	10,003,000.30	8.32	10,003,000.30	8.32	3 年

#### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华食品饮料量化股票发起式 A	银华食品饮料量化股票发起式 C
基金合同生效日 (2017 年 11 月 9 日)	11,498,723.05	2,028,052.35
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	69,011,344.93	58,932,420.18
本报告期基金总申购份额	7,506,063.68	164,447,096.16
减：本报告期基金总赎回份额	14,793,171.37	164,859,074.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	61,724,237.24	58,520,441.86
--------------	---------------	---------------

注：如有相应情况，总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2025 年 4 月 26 日发布关于公司副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，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。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)		

国泰海通	6	209,228,745. 71	22.57	93,290.19	22.57	-
东方财富	5	191,703,642. 42	20.68	85,480.37	20.68	-
招商证券	1	172,982,062. 11	18.66	77,125.41	18.66	-
国联民生 证券	1	105,501,797. 68	11.38	47,043.85	11.38	-
浙商证券	2	97,768,580.4 3	10.55	43,594.50	10.55	-
野村东方 国际证券	2	60,117,396.6 7	6.49	26,804.24	6.49	-
西部证券	1	35,282,577.8 8	3.81	15,734.60	3.81	-
中信证券	2	20,278,451.1 5	2.19	9,043.05	2.19	-
国盛证券	2	18,021,568.2 7	1.94	8,036.03	1.94	-
国投证券	2	10,404,706.2 0	1.12	4,639.63	1.12	-
东吴证券	2	5,575,826.00	0.60	2,486.48	0.60	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰海通	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华食品饮料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	《银华食品饮料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
4	《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
5	《银华食品饮料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

6	《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
7	《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
8	《银华食品饮料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 5 月 9 日
9	《银华食品饮料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 5 月 9 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20% 的单一投资者的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2025 年 8 月 29 日