

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)
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
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	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20

7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	50
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	50
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	50
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	50
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	51
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	51
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	51
8.11 投资组合报告附注	51
§ 9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末上市基金前十名持有人	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
9.4 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.....	53
§ 10 开放式基金份额变动	53
§ 11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
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.....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
11.8 其他重大事件	54
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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	57
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 13 备查文件目录	57
13.1 备查文件目录	57
13.2 存放地点	57
13.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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)
基金简称	新经济
场内简称	新经济 ETF
基金主代码	159822
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 29 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	299,734,315.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 10 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于标的 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.3% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金投资于标的 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为经估值汇率调整的标的指数收益率。本基金标的指数为标普中国新经济行业（A 股上限）指数（S&P New China Sectors (A-Shares Capped) Index）。
风险收益特征	本基金标的 ETF 为股票指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的 ETF，紧密跟踪指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金为境外证券投资的基金，主要投资于香港证券市场上市的 ETF 产品。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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
	联系电话	(010) 58163000
		郭明
		(010) 66105799

电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4006783333, (010)85186558	95588
传真	(010)58163027	(010)66105798
注册地址	广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 C2 办公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100738	100140
法定代表人	王珠林	陈四清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES
	中文	法国巴黎银行全球托管行
注册地址	-	3 rue dAntin, 750002 Paris, 法国
办公地址	-	3 rue dAntin, 750002 Paris, 法国
邮政编码	-	75002 Paris

2.5 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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座 普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-15,867,914.85	-66,692,289.28	6,257,251.55
本期利润	-24,256,135.24	-37,262,560.09	-111,169,675.24
加权平均基金份额	-0.0796	-0.1012	-0.2785

本期利润			
本期加权平均净值利润率	-12.66%	-15.65%	-28.58%
本期基金份额净值增长率	-13.59%	-13.18%	-29.20%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-129,482,611.03	-110,611,609.76	-104,119,223.76
期末可供分配基金份额利润	-0.4320	-0.3427	-0.2429
期末基金资产净值	170,251,703.97	212,122,705.24	324,615,091.24
期末基金份额净值	0.5680	0.6573	0.7571
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-43.20%	-34.27%	-24.29%

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。

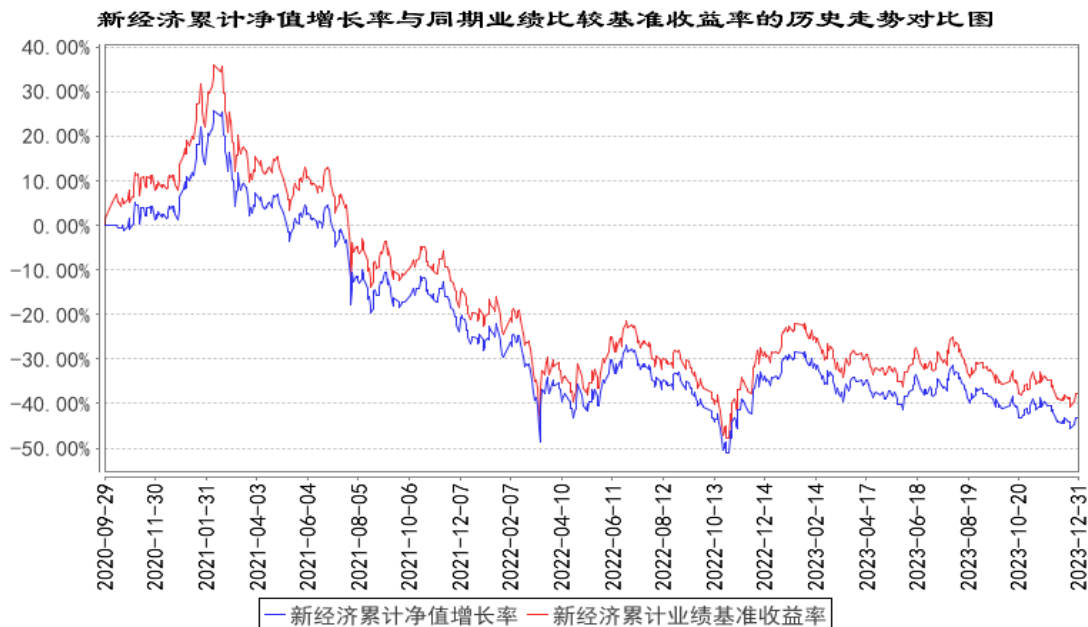
3.2 基金净值表现

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

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	-3.47%	1.43%	-3.15%	1.49%	-0.32%	-0.06%
过去六个月	-8.80%	1.44%	-8.34%	1.51%	-0.46%	-0.07%
过去一年	-13.59%	1.49%	-12.78%	1.55%	-0.81%	-0.06%
过去三年	-47.39%	2.00%	-50.49%	2.09%	3.10%	-0.09%

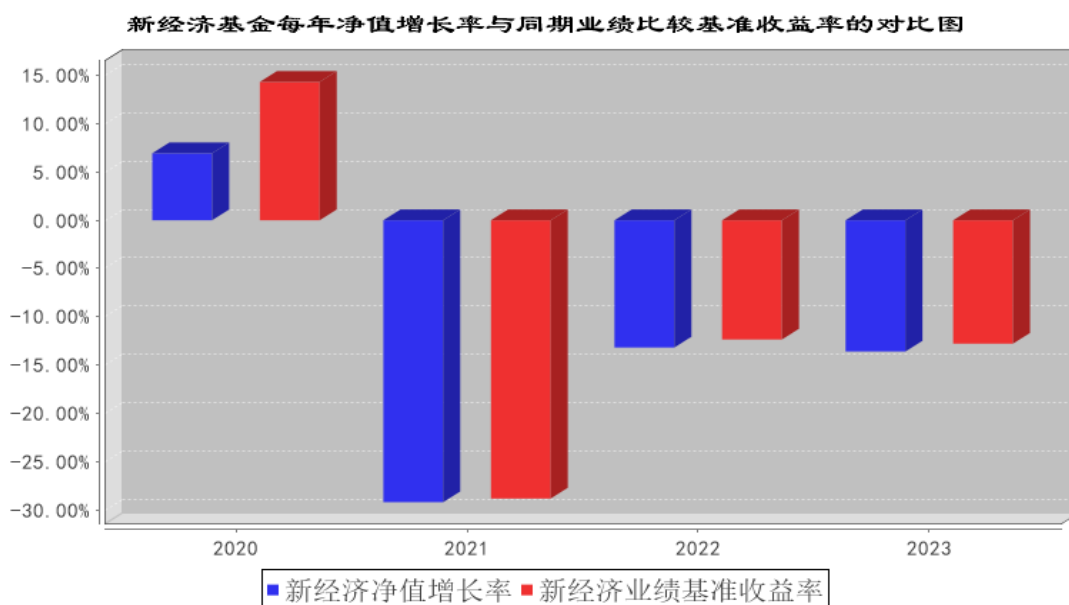
自基金合同生效起至今	-43.20%	1.96%	-37.79%	2.06%	-5.41%	-0.10%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

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



注：本基金合同生效日期为 2020 年 9 月 29 日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期。截至建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分的规定：本基金投资于标的 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。

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



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

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2.222 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 44.10%，第一创业证券股份有限公司 26.10%，东北证券股份有限公司 18.90%，山西海鑫实业有限公司 0.90%，珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人管理 197 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证
券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优
选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、
银华领先策略混合型证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华增强收益债券
型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数证券投资基金
(LOF)、银华深证 100 指数证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用
双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数证券投
资基金 (LOF)、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题混合型证券投资基金、银
华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、银华交易型
货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银
华恒生中国企业指数证券投资基金 (QDII-LOF)、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市
场基金、银华安颐中短债双月持有期债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证
券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、
银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华聚利灵活配
置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证
券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题
灵活配置混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证
券投资基金、银

华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华华茂定期开放债券型证券投资基金、银华心怡灵活配置混合型证券投资基金、银华可转债债券型证券投资基金、银华中短期政策性金融债定期开放债券型证券投资基金、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金、银华行业轮动混合型证券投资基金、银华信用精选一年定期开放债券型发起式证券投资基金、银华安丰中短期政策性金融债债券型证券投资基金、银华安盈短债债券型证券投资基金、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华盛利混合型发起式证券投资基金、银华安鑫短债债券型证券投资基金、银华 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、银华美元债精选债券型证券投资基金（QDII）、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊尚稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊和养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊和养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟 39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中证 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业

交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华乐享混合型证券投资基金、银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心佳两年持有期混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、银华远兴一年持有期债券型证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金、银华稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、银华心享一年持有期混合型证券投资基金、银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、银华瑞祥一年持有期混合型证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金、银华阿尔法混合型证券投资基金、银华富饶精选三年持有期混合型证券投资基金、银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选两年定期开放债券型证券投资基金、银华长荣混合型证券投资基金、银华中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、银华多元回报一年持有期混合型证券投资基金、银华鑫利一年持有期混合型证券投资基金、银华中证虚拟现实主题交易型开放式指数证券投资基金、银华安盛混合型证券投资基金、银华富久食品饮料精选混合型证券投资基金 (LOF)、银华华智三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、银华智能建造股票型发起式证券投资基金、银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华季季盈 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、银华华证 ESG 领先指数证券投资基金、银华顺益一年定期开放债券型证券投资基金、银华永丰债券型证券投资基金、银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、银华集成电路混合型证券投资基金、银华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金、银华尊颐稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金、银华中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证内地地产主题交易型开放式指数证券投资基金、银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、银华心兴三年持有期混合型证券

投资基金、银华心选一年持有期混合型证券投资基金、银华尊禧稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）、银华新锐成长混合型证券投资基金、银华尊和养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华鑫峰混合型证券投资基金、银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华数字经济股票型发起式证券投资基金、银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、银华中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金、银华核心动力精选混合型证券投资基金、银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金、银华玉衡定投三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华华利均衡优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、银华沪深 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、银华绿色低碳债券型证券投资基金、银华卓信成长精选混合型证券投资基金、银华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华沪深 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华创新动力优选混合型证券投资基金、银华动力领航混合型证券投资基金、银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金（QDII）、银华心质混合型证券投资基金、银华顺璟 6 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金、银华清洁能源产业混合型证券投资基金、银华中证国新央企科技引领交易型开放式指数证券投资基金、银华顺和债券型证券投资基金、银华中证 800 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华医疗健康混合型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华月月享 30 天持有期债券型证券投资基金、银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华惠享三年定期开放混合型证券投资基金、银华中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、银华创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金、银华致淳债券型证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马君女士	本基金的基金经理	2020 年 9 月 29 日	-	15.5 年	硕士学位。2008 年 7 月至 2009 年 3 月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009 年 3 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任研究员及基金经理助理职务。自 2012 年 9 月 4 日至 2020 年 11 月 30 日担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理，2013 年 12 月

				<p>16 日至 2015 年 7 月 16 日兼任银华消费主题分级混合型证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 6 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 8 月 13 日至 2016 年 8 月 5 日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，自 2016 年 1 月 14 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 12 月 10 日兼任银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 11 月 9 日至 2021 年 2 月 25 日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 2017 年 11 月 9 日起兼任银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2017 年 12 月 15 日起兼任银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 5 月 11 日至 2021 年 8 月 18 日兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自 2020 年 9 月 22 日至 2022 年 8 月 9 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 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 12 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证农业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 3 日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 20 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自 2022 年 6 月 2 日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经</p>
--	--	--	--	--

					理,自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华中证中药交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2023 年 3 月 15 日起兼任银华海外数字经济量化选股混合型发起式证券投资基金(QDII)基金经理,自 2023 年 3 月 17 日起兼任银华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2023 年 4 月 7 日起兼任银华中证 500 价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2023 年 9 月 6 日起兼任银华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2024 年 1 月 3 日起兼任银华国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
李宜璇女士	本基金的基金经理	2020 年 9 月 29 日	-	10 年	博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司,2014 年 12 月加入银华基金,历任量化投资部量化研究员、基金经理助理,现任量化投资部基金经理。自 2017 年 12 月 25 日起担任银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)基金经理,自 2018 年 3 月 7 日至 2020 年 12 月 31 日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理,自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 1 月 13 日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自 2018 年 3 月 7 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理,自 2018 年 3 月 7 日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金经理,自 2020 年 10 月 29 日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理,自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理,自 2021 年 1 月 5 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自 2021 年 2 月 9 日至 2022 年 6 月

					29 日兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 29 日兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 25 日起兼任银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 24 日至 2021 年 12 月 21 日兼任银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 26 日起兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 1 月 17 日起兼任银华恒生港股通中国科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2022 年 4 月 7 日起兼任银华全球新能源车量化优选股票型发起式证券投资基金（QDII）基金经理，自 2022 年 7 月 20 日起兼任银华专精特新量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
谭普景先生	本基金的基金经理助理	2021 年 4 月 19 日	-	10 年	学士学位。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，历任信息技术部开发工程师、开发主管、量化投资部量化研究员，现任量化投资部基金经理助理。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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

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

我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件，将本基金的跟踪误差控制在合理水平，并取得一定的相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.5680 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.59%，业绩比较基准收益率为-12.78%。报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年，宏观经济逐渐从疫情中走出，从年初以来，整体呈现了从脉冲反弹到脉冲回落，最终缓慢复苏的运行特点。分经济部门来看，居民出行、居民消费等领域处于持续的复苏通道中，这在各个节假日的数据中体现明显；同时，商务活动尤其是与地产链条相关的商务活动，复苏进

程仍然较弱，这在消费价位段、投融资结构等数据上有所显现。从海外来看，美联储在全年内以加息为主，使得外汇和国际资本流动都面临新的环境特点。这些外部因素在年末也正在迎来边际上的变化。在上述因素的作用下，A股和港股市场主要指数在2023年表现不佳。

展望2024年我们认为，经济周期的回落与经济的新旧更替正在同步发生，我们正处于这样的进程中。随着这个进程的深入，经济活动的扩张、收入水平的提升，都将是一个缓慢且持续的过程；而随着新旧更替的深入，经济也将会逐渐出现一些新的特点。未来一段时期，国内政策、汇率水平、海外地缘冲突等指标将是新的边际影响变量，我们也将对此进行持续的观察。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

本报告期内，本基金管理人根据监管规则、公司业务发展情况，建立合规风险库机制并动态更新，要求业务部门定期对照自查，加强一道防线作用，夯实合规主体责任，尽早发现和处置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、反洗钱业务等业务环节的合规检查工作，督促责任部门落实整改，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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 2023 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 27616 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)全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了银华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)(以下简称“新经济”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了新经济 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于新经济,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	不适用。
其他事项	不适用。
其他信息	不适用。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>新经济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新经济的持续经营能力,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新经济、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新经济的财务报告过程。</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>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对新经济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新经济不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈熹 崔泽宇
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华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)

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	7,502,663.71	14,399,773.24
结算备付金		-	0.93
存出保证金		-	-

交易性金融资产	7.4.7.2	163,024,670.01	204,241,895.03
其中：股票投资		-	-
基金投资		163,024,670.01	204,241,895.03
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	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		1,178,301.77	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		171,705,635.49	218,641,669.20
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,224,123.18	6,275,270.82
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,577.36	45,495.08
应付托管费		14,230.98	18,198.06
应付销售服务费		-	-
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	180,000.00	180,000.00
负债合计		1,453,931.52	6,518,963.96
净 资 产：			
实收基金	7.4.7.10	299,734,315.00	322,734,315.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-129,482,611.03	-110,611,609.76
净资产合计		170,251,703.97	212,122,705.24

负债和净资产总计		171,705,635.49	218,641,669.20
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5680 元，基金份额总额 299,734,315.00 份。

7.2 利润表

会计主体：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)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-23,404,266.13	-36,243,607.30
1. 利息收入		66,432.42	52,409.16
其中：存款利息收入	7.4.7.13	66,432.42	52,409.16
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）		-15,426,490.26	-65,307,677.45
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益	7.4.7.15	-15,426,490.26	-65,307,677.45
债券投资收益	7.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	-	-
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）	7.4.7.21	-8,388,220.39	29,429,729.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-54,576.55	-250,187.76
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	398,588.65	-167,880.44
减：二、营业总支出		851,869.11	1,018,952.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	479,645.04	598,990.54
其中：暂估管理人报酬		-	-

2. 托管费	7.4.10.2.2	191,858.07	239,596.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.24	180,366.00	180,366.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,256,135.24	-37,262,560.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,256,135.24	-37,262,560.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,256,135.24	-37,262,560.09

7.3 净资产变动表

会计主体：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)

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	322,734,315.00	-	-110,611,609.76	212,122,705.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	322,734,315.00	-	-110,611,609.76	212,122,705.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-23,000,000.00	-	-18,871,001.27	-41,871,001.27
(一)、综合收益总额	-	-	-24,256,135.24	-24,256,135.24
(二)、本期基金份额交易产生的	-23,000,000.00	-	5,385,133.97	-17,614,866.03

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	101,500,000.00	-	-37,307,373.45	64,192,626.55
2. 基金赎 回款	-124,500,000.0 0	-	42,692,507.42	-81,807,492.58
(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	299,734,315.00	-	-129,482,611.0 3	170,251,703.97
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	428,734,315.00	-	-104,119,223.7 6	324,615,091.24
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	428,734,315.00	-	-104,119,223.7 6	324,615,091.24
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-106,000,000.0 0	-	-6,492,386.00	-112,492,386.00
(一)、综合收益 总额	-	-	-37,262,560.09	-37,262,560.09
(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)	-106,000,000.0 0	-	30,770,174.09	-75,229,825.91

其中：1. 基金申购款	191,500,000.00	-	-72,897,136.44	118,602,863.56
2. 基金赎回款	-297,500,000.00	-	103,667,310.53	-193,832,689.47
(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	322,734,315.00	-	-110,611,609.76	212,122,705.24

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) (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[2020]1968 号《关于准予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)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)基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,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 902,189,000.00 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(2020)第 0813 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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)基金合同》于 2020 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 902,234,315.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 45,315.00 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”)，法国巴黎银行全球托管行担任境外托管人。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]948号核准，本基金 902,234,315.00 份基金份额于 2020 年 10 月 23 日在深交所挂牌交易。本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

本基金的标的 ETF 为南方东英资产管理有限公司管理的，并于香港联交所上市的工银南方东英标普中国新经济行业 ETF。本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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)基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的 ETF，为更好地实现投资目标，基金还可投资于标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品以及其他境内市场和境外市场依法发行的金融工具。境内市场投资工具包括国内依法发行上市的股票(包括主板股票、中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、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的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单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。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证、政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券及中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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。其中，本基金在投资香港市场时，可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。本基金投资于标的 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金的业绩比较基准为：经估值汇率调整的标的指数收益率。本基金标的指数为标普中国新经济行业(A 股上限)指数(S&P New China Sectors(A-Shares Capped) Index)。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《银华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)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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商业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、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支

持有的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应

权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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和托管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

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。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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。

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。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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

无。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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[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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或

地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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。基金通过沪港通或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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	7,502,663.71	14,399,773.24
等于：本金	7,502,253.48	14,399,123.76
加：应计利息	410.23	649.48
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	7,502,663.71	14,399,773.24

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		-	-	-	-
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		221,794,693.77	-	163,024,670.01	-58,770,023.76
其他		-	-	-	-
合计		221,794,693.77	-	163,024,670.01	-58,770,023.76
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
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		254,623,698.40	-	204,241,895.03	-50,381,803.37
其他		-	-	-	-
合计		254,623,698.40	-	204,241,895.03	-50,381,803.37

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	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	180,000.00	180,000.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	322,734,315.00	322,734,315.00
本期申购	101,500,000.00	101,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-124,500,000.00	-124,500,000.00
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	299,734,315.00	299,734,315.00

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

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-48,861,426.27	-61,750,183.49	-110,611,609.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-48,861,426.27	-61,750,183.49	-110,611,609.76
本期利润	-15,867,914.85	-8,388,220.39	-24,256,135.24
本期基金份额交易产生的变动数	3,733,701.70	1,651,432.27	5,385,133.97
其中：基金申购款	-18,081,413.60	-19,225,959.85	-37,307,373.45
	21,815,115.30	20,877,392.12	42,692,507.42

金赎回款			
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,995,639.42	-68,486,971.61	-129,482,611.03

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	66,421.93	52,365.34
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	10.49	43.82
其他	-	-
合计	66,432.42	52,409.16

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

注：无。

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	68,833,605.59	181,277,585.50
减：卖出/赎回基金成本总额	84,260,095.85	246,585,262.95
减：买卖基金差价收入应缴	-	-

纳增值税额		
减：交易费用	-	-
基金投资收益	-15,426,490.26	-65,307,677.45

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.20 股利收益

注：无。

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-8,388,220.39	29,429,729.19
股票投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-8,388,220.39	29,429,729.19
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	-8,388,220.39	29,429,729.19

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	398,588.65	-167,880.44
合计	398,588.65	-167,880.44

7.4.7.23 信用减值损失

注：无。

7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31
----	-------------------------	---------------------------------

	月 31 日	日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	366.00	366.00
合计	180,366.00	180,366.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

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

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 基金交易

注：无。

7.4.10.1.5 权证交易

注：无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	479,645.04	598,990.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	45,516.19	53,444.72
应支付基金管理人的净管理费	434,128.85	545,545.82

注：支付基金管理人银华基金管理股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.25% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	191,858.07	239,596.25

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 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
法国巴黎银行	3,184,854.72	-	5,680,882.55	-
中国工商银行	4,317,808.99	66,421.93	8,718,890.69	52,365.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人法国巴黎银行保管，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。

7.4.10.9 利润分配情况

注：无。

7.4.11 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.12 金融工具风险及管理

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 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随时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。

7.4.12.3.1 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。

本基金主要投资于上市交易的证券，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。

7.4.12.4 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。

7.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险，特别是因债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

7.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,502,663.71	-	-	-	7,502,663.71
交易性金融资产	-	-	-	163,024,670.01	163,024,670.01
应收清算款	-	-	-	1,178,301.77	1,178,301.77
资产总计	7,502,663.71	-	-	164,202,971.78	171,705,635.49
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	35,577.36	35,577.36
应付托管费	-	-	-	14,230.98	14,230.98
应付清算款	-	-	-	1,224,123.18	1,224,123.18
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,453,931.52	1,453,931.52
利率敏感度缺口	7,502,663.71	-	-	162,749,040.26	170,251,703.97
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	14,399,773.24	-	-	-	14,399,773.24
结算备付金	0.93	-	-	-	0.93
交易性金融资产	-	-	-	204,241,895.03	204,241,895.03
资产总计	14,399,774.17	-	-	204,241,895.03	218,641,669.20
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	45,495.08	45,495.08
应付托管费	-	-	-	18,198.06	18,198.06
应付清算款	-	-	-	6,275,270.82	6,275,270.82
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	6,518,963.96	6,518,963.96
利率敏感度缺口	14,399,774.17	-	-	197,722,931.07	212,122,705.24

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。

7.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本期末（上期末）持有的资产占基金净资产的比例不重大，因此市场利率的变动对于

本基金净资产无重大影响。

7.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	3,185,060.44	-	3,185,060.44
交易性金融资产	-	163,024,670.01	-	163,024,670.01
应收清算款	-	1,178,100.48	-	1,178,100.48
资产合计	-	167,387,830.93	-	167,387,830.93
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	167,387,830.93	-	167,387,830.93
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	5,681,085.30	-	5,681,085.30
交易性金融资产	-	204,241,895.03	-	204,241,895.03
资产合计	-	209,922,980.33	-	209,922,980.33
以外币计价的负债				

应付清算款	-	803,922.91	-	803,922.91
负债合计	-	803,922.91	-	803,922.91
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	209,119,057.42	-	209,119,057.42

7.4.12.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低汇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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	港币+5%	8,369,392.00	10,455,952.87
	港币-5%	-8,369,392.00	-10,455,952.87

7.4.12.4.3 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来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

7.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	163,024,670.01	95.76	204,241,895.03	96.28
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	163,024,670.01	95.76	204,241,895.03	96.28

7.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	+5%	8,129,088.53	10,111,310.23
	-5%	-8,129,088.53	-10,111,310.23

7.4.13 公允价值

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.13.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	163,024,670.01	204,241,895.03

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	163,024,670.01	204,241,895.03

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.13.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

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

注：无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.14 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-

	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	163,024,670.01	94.94
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,502,663.71	4.37
8	其他各项资产	1,178,301.77	0.69
9	合计	171,705,635.49	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

8.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

8.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

8.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

注：本基金本报告期末未持有权益投资。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：无。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

注：无。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

注：无。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	工银南方东英标普中国新经济行业ETF (ICBC CSOP S&P NEW CHINA SECTORS ETF)	股票型	交易型开放式 (ETF)	南方东英资产管理有限公司 (CSOP ASSET MANAGEMENT LIMITED)	163,024,670.01	95.76

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票，因此本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	1,178,301.77
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,178,301.77

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金报告期末未持有股票。

8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.11.6 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

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 (%)
9,888	30,312.94	10,768,357.00	3.59	288,965,958.00	96.41

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	BARCLAYSBANKPLC	5,153,101.00	1.72
2	王梦宜	4,372,000.00	1.46
3	郭起新	3,348,729.00	1.12
4	中信证券股份有限公司	2,524,626.00	0.84
5	康金平	2,509,048.00	0.84
6	陶百华	2,500,000.00	0.83
7	华泰证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	2,406,219.00	0.80
8	李卫华	1,800,014.00	0.60
9	陈佩珍	1,610,000.00	0.54
10	杨宪群	1,500,101.00	0.50

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 9 月 29 日） 基金份额总额	902,234,315.00
本报告期期初基金份额总额	322,734,315.00
本报告期基金总申购份额	101,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	124,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	299,734,315.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

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

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 60,000.00 元。该审计机构已经为本基金连续提供了四年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

注：本基金本报告期未通过交易单元进行股票投资。

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

注：本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

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	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资(如有)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, 上海证券报, 证券时报	2023 年 1 月 12 日
2	《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)2022 年第 4 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
3	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 1 月 20 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资(如有)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, 上海证券报, 证券时报	2023 年 2 月 16 日
5	《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)2022 年年度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 31 日
6	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 3 月 31 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于旗	本基金管理人网站, 中	2023 年 4 月 4 日

	下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	
8	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 4 月 17 日
9	《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)2023 年第 1 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 20 日
10	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 4 月 20 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于增加国泰君安证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 三大证券报	2023 年 4 月 27 日
12	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	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	2023 年 5 月 24 日
13	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资(如有)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, 三大证券报	2023 年 6 月 15 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资(如有)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, 三大证券报	2023 年 6 月 30 日
15	《银华基金管理股份有限公司关于增加华福证券有限责任公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 7 月 7 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、赎回业务的公告》	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	2023 年 7 月 17 日
17	《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)2023 年第 2 季度报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 19 日
18	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 7 月 19 日
19	《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)2023 年中期报告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2023 年 8 月 29 日
20	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告》	四大证券报	2023 年 8 月 29 日
21	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回及	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露	2023 年 8 月 31 日

	定期定额投资(如有)业务的公告》	网站,三大证券报	
22	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、赎回业务的公告》	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	2023年9月1日
23	《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)基金产品资料概要更新》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2023年9月7日
24	《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)招募说明书更新(2023年第1号)》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2023年9月7日
25	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、赎回业务的公告》	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	2023年9月8日
26	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2023年9月21日
27	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金临时暂停申购、赎回业务的公告》	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	2023年10月9日
28	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2023年10月11日
29	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、转换(如有)及定期定额投资业务的公告》	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	2023年10月19日
30	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2023年第3季度报告提示性公告》	四大证券报	2023年10月24日
31	《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)2023年第3季度报告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站	2023年10月24日
32	《银华基金管理股份有限公司关于增加部分代销机构为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2023年10月24日
33	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资(如有)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,三大证券报	2023年11月20日
34	《银华基金管理股份有限公司关于增加浙商证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露网站,四大证券报	2023年11月29日
35	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金暂停及恢复申购、赎回、	本基金管理人网站,中国证监会基金电子披露	2023年12月21日

	转换（如有）及定期定额投资业务的公告》	网站, 四大证券报	
36	《银华基金管理股份有限公司关于增加华金证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告》	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站, 四大证券报	2023 年 12 月 26 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

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。

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）募集申请获中国证监会注册的文件

13.1.2 《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）基金合同》

13.1.3 《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）招募说明书》

13.1.4 《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）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 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2024 年 3 月 29 日