

银华新能源新材料量化优选股票型发起式
证券投资基金
2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 26 日

§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。本半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 2019 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	银华新能源新材料量化股票发起式	
基金主代码	005037	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 15 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	64,555,288.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	银华新能源新材料量化股票发起式 A	银华新能源新材料量化股票发起式 C
下属分级基金的交易代码:	005037	005038
报告期末下属分级基金的份额总额	34,766,463.36 份	29,788,825.03 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，重点投资于新能源新材料产业的上市公司，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	本基金综合使用包括但不限于如下多种量化投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金投资于新能源新材料主题，使用主动量化策略对新能源新材料主题界定内的股票进行筛选并进行权重的优化，力争在跟踪新能源新材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。基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；投资于新能源新材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%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；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%。
业绩比较基准	中证全指能源指数收益率×45%+中证全指原材料指数收益率×45%+商业银行人民币活期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，属于证券投资基金中风险和预期收益较高的品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§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

基金级别	银华新能源新材料量化股票发起式 A	银华新能源新材料量化股票发起式 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	1,755,463.81	1,387,879.13
本期利润	2,939,503.27	2,276,198.70
加权平均基金份额本期利润	0.0805	0.0747
本期加权平均净值利润率	10.50%	9.80%
本期基金份额净值增长率	11.00%	10.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配利润	-9,799,379.51	-8,567,987.71
期末可供分配基金份额利润	-0.2819	-0.2876
期末基金资产净值	25,675,398.00	21,817,402.74
期末基金份额净值	0.7385	0.7324
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-26.15%	-26.76%

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

银华新能源新材料量化股票发起式 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	-0.47%	1.22%	0.39%	1.00%	-0.86%	0.22%
过去三个月	-9.34%	1.59%	-6.12%	1.55%	-3.22%	0.04%
过去六个月	11.00%	1.62%	14.03%	1.46%	-3.03%	0.16%
过去一年	-1.18%	1.59%	-4.84%	1.39%	3.66%	0.20%
自基金合同生效起至今	-26.15%	1.44%	-25.53%	1.29%	-0.62%	0.15%

银华新能源新材料量化股票发起式 C

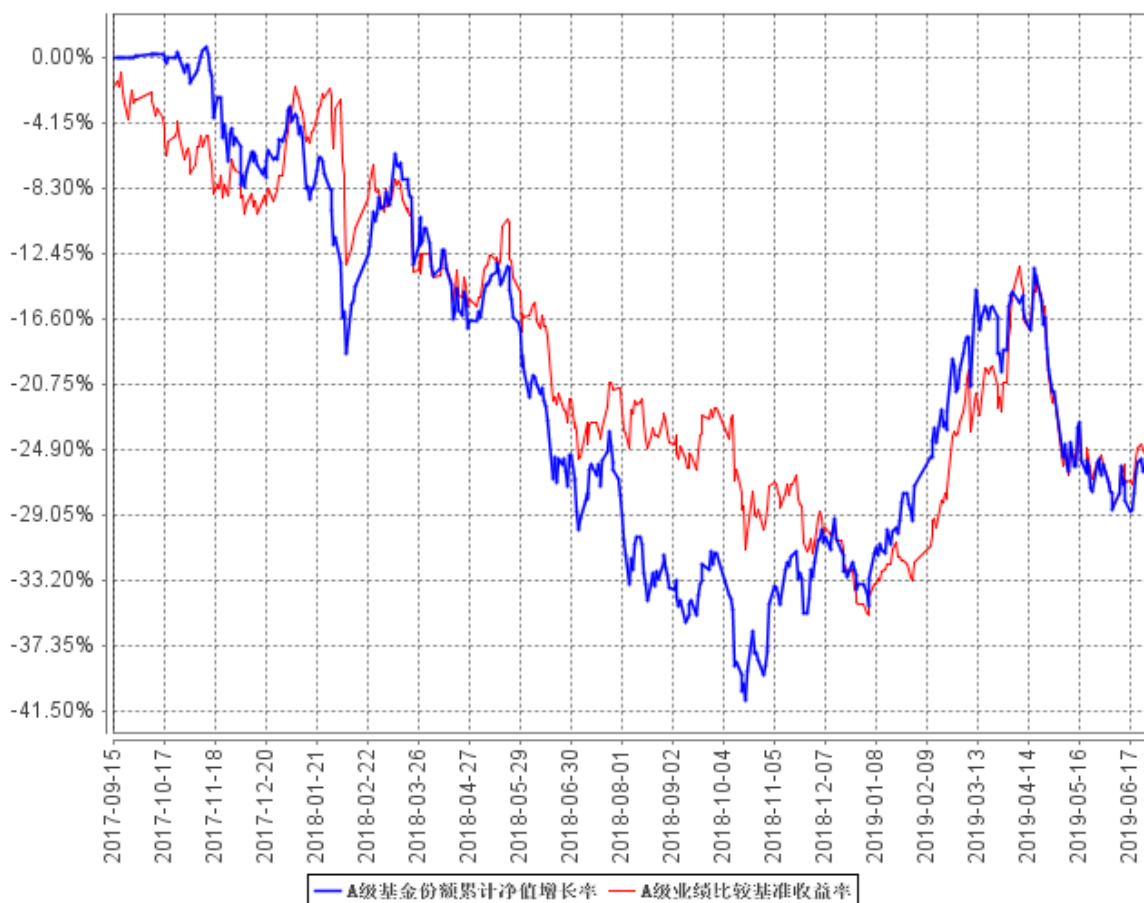
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.50%	1.22%	0.39%	1.00%	-0.89%	0.22%
过去三个月	-9.45%	1.59%	-6.12%	1.55%	-3.33%	0.04%
过去六个月	10.73%	1.62%	14.03%	1.46%	-3.30%	0.16%
过去一年	-1.63%	1.59%	-4.84%	1.39%	3.21%	0.20%
自基金合同生效起至今	-26.76%	1.44%	-25.53%	1.29%	-1.23%	0.15%

注：本基金的业绩比较基准为：中证全指能源指数收益率*45%+中证全指原材料指数收益率*45%+商业银行人民币活期存款利率（税后）*10%。

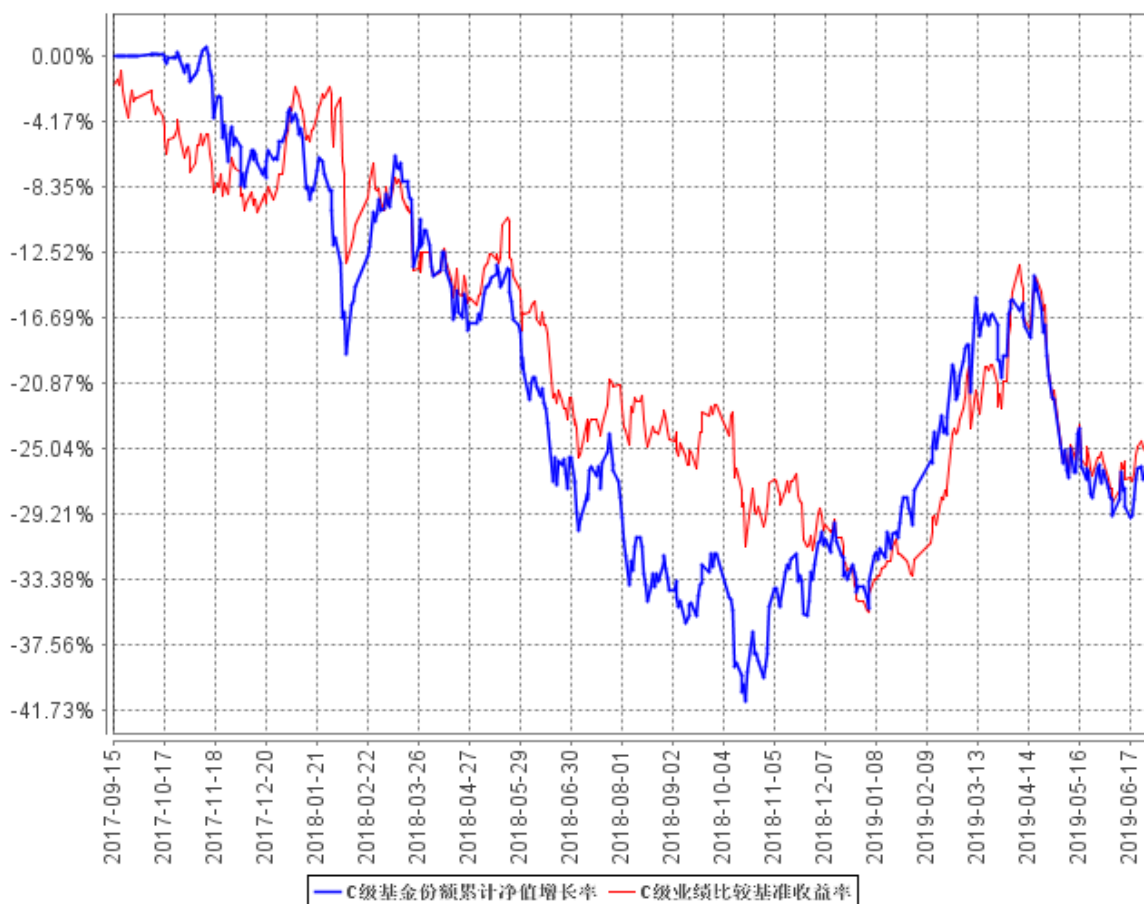
本基金股票部分主要投资于新能源新材料主题的股票，包阔新型能源和新型材料两个部分。中证全指能源指数和中证全指原材料指数基本反映了沪深 A 股中新能源新材料股票的整体表现，对本基金定义的新能源新材料主体具有较强的代表性。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束故事本基金的各项资产配置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%；投资于新能源新材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%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需要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%。

§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%，山西海鑫实业股份有限公司 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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 115 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、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、银华全球核心优选证券投资基金、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 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、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 指数分级证券投资基金、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、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)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(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、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财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、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、

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、银华逆向投资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、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、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、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、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）、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金、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、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证 5 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证 10 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票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、银华文体娱乐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、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、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、银华智荟分红收益灵活配置混合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、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、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、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈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、银华中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、银华远见混合型发起式证券投资基金、银华安享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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李宜璇女士	本基金的基金经理	2018 年 3 月 7 日	-	5 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、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、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、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。具有从业资格。国籍：中国。
杨腾先生	本基金的基金经理助理	2017 年 10 月 12 日	-	6.5 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 年加入银华基金，历任量化研究员，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之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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况有 1 次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，市场跌宕起伏，在经历了一季度大幅上涨，创下年内新高后，二季度，受到中美贸易战摩擦加剧的影响，市场快速下跌，后呈现震荡格局。上半年创业板上涨 20.9%，沪深 300 上涨 27.1%。新能源新材料相关行业中，有色和电力设备板块涨幅靠前，分别上涨 20.1%和 16.6%，汽车板块上涨 9.9%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华新能源新材料量化股票发起式 A 基金份额净值为 0.7385 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.00%；截至本报告期末银华新能源新材料量化股票发起式 C 基金份额净值为 0.7324 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.73%；同期业绩比较基准收益率为 14.03%。

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 2019 年下半年，市场经历快速下跌及震荡行情后，中美贸易战的影响逐渐被市场所消化。G20 会议后，市场风险偏好向上修复一定程度，国内基本面情况将重新成为市场的关注点。一方面，不宜对贸易战发展情况过于乐观，中美贸易战将成为中长期两国关系的常态，后续谈判可能依然有波折；另一方面，国内政策在稳增长与调结构之间发力，企业利润的修复需要一定的时间周期。从行业层面看，电力设备具备一定的逆经济周期的投资属性，新能源发电板块景气高企；光伏板块海外需求持续景气，行业有望量利齐升；国内风电存量项目建设进度加速，近期风机投标价格反弹超预期，利好风电产业链；新能源汽车产业链尽管短期基本面承压，但政策基调或将先抑后扬，行业未来成长性强。整体而言，新能源新材料行业发展空间广阔，看好投资前景，价值与成长兼备，我们将根据市场变化对组合进行持续的优化调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基

金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2018 年 7 月 31 日至 2019 年 2 月 12 日、2019 年 5 月 6 日至 2019 年 6 月 30 日。由于本基金属于发起式基金，无需向中国证监会报告并提出解决方案。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的相关规定，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，银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金的管理人——银华基金管理股份有限公司在银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半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银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	4,247,239.45	3,889,432.81
结算备付金	188,078.86	135,365.42
存出保证金	19,459.73	16,051.96
交易性金融资产	43,158,944.26	39,255,465.91
其中：股票投资	43,158,944.26	39,255,465.91
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	958.58	978.76
应收股利	-	-
应收申购款	153,723.17	35,702.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	47,768,404.05	43,332,997.07
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	77,803.95	137,808.35
应付管理人报酬	38,745.92	37,060.86
应付托管费	3,874.58	3,706.11
应付销售服务费	7,070.33	6,633.79
应付交易费用	91,847.26	69,544.07
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	56,261.27	145,020.13
负债合计	275,603.31	399,773.31
所有者权益：		
实收基金	64,555,288.39	64,702,765.01
未分配利润	-17,062,487.65	-21,769,541.25
所有者权益合计	47,492,800.74	42,933,223.76
负债和所有者权益总计	47,768,404.05	43,332,997.07

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，银华新能源新材料量化股票发起式 A 基金份额净值

0.7385 元，基金份额总额 34,766,463.36 份；银华新能源新材料量化股票发起式 C 基金份额净值 0.7324 元，基金份额总额 29,788,825.03 份。银华新能源新材料量化股票发起式份额总额合计为 64,555,288.39 份。

6.2 利润表

会计主体：银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	5,954,355.78	-13,868,291.19
1.利息收入	32,181.89	40,402.74
其中：存款利息收入	27,496.96	18,026.85
债券利息收入	-	22,375.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,684.93	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,678,860.82	-11,876,553.57
其中：股票投资收益	3,478,882.57	-12,215,386.44
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	400.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	199,978.25	338,432.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,072,359.03	-2,062,874.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填	-	-

列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	170,954.04	30,734.32
减：二、费用	738,653.81	1,012,907.55
1. 管理人报酬	253,017.35	322,339.14
2. 托管费	25,301.70	32,233.88
3. 销售服务费	45,869.69	67,351.73
4. 交易费用	357,026.76	517,789.33
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	57,438.31	73,193.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,215,701.97	-14,881,198.74
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	5,215,701.97	-14,881,198.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	64,702,765.01	-21,769,541.25	42,933,223.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,215,701.97	5,215,701.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-147,476.62	-508,648.37	-656,124.99
其中：1.基金申购款	36,530,061.14	-8,022,462.58	28,507,598.56
2.基金赎回款	-36,677,537.76	7,513,814.21	-29,163,723.55
四、本期向基金份额	-	-	-

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.2.3 差错更正的说明

无。

6.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、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》、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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税; 2018年1月1日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税;

(2) 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, 暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 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, 其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

(4) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税;

(5) 对于基金从事A股买卖, 出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方

不再缴纳印花税；

(6) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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

本基金管理人于 2019 年 4 月 13 日发布《银华基金管理股份有限公司关于子公司名称及住所变更的公告》，公司全资子公司（原银华财富资本管理（北京）有限公司）已完成名称及住所变更，并已办理变更工商登记。名称变更为“银华资本管理（珠海横琴）有限公司”，住所变更为“珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-67069（集中办公区）”。

6.4.4.2 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
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
银华基金管理股份有限公司	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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券	2,616,710.39	1.00%	-	-

6.4.5.1.2 债券交易

注：无。

6.4.5.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.5.1.4 权证交易

注：无。

6.4.5.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券	1,913.81	0.95%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	253,017.35	322,339.14
其中：支付销售机构的客户维护费	111,481.20	202,714.05

注：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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付，支付日期顺延。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,301.70	32,233.88

注：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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付，支付日期顺延。

6.4.5.2.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华新能源新材料 量化股票发起式 A	银华新能源新材料 量化股票发起式 C	合计
中国工商银行	-	34,773.53	34,773.53
银华基金管理股份有限公司	-	80.63	80.63
合计	-	34,854.16	34,854.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银华新能源新材料 量化股票发起式 A	银华新能源新材料 量化股票发起式 C	合计
银华基金管理股份有限公司	-	17.20	17.20
中国工商银行	-	62,873.64	62,873.64
合计	-	62,890.84	62,890.84

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 的年费率计提。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

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付，支付日期顺延。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	银华新能源新材料量化股票发起式 A	银华新能源新材料量化股票发起式 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 15 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,002,000.20	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,002,000.20	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.77%	-

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	银华新能源新材料量化股票发起式 A	银华新能源新材料量化股票发起式 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 15 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,002,000.20	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,002,000.20	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	29.12%	-

- 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、本基金的基金管理人运用自有资金作为发起资金于基金募集期间认购了本基金的基金份额，自本基金基金合同生效之日起，所认购的基金份额持有期限不低于三年。
- 3、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。

6.4.5.4.2 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。

6.4.5.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	4,247,239.45	25,538.37	5,424,706.20	15,574.39

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.5.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.6 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

注：无。

6.4.7 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	43,158,944.26	90.35
	其中：股票	43,158,944.26	90.35
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	4,435,318.31	9.29
8	其他各项资产	174,141.48	0.36
9	合计	47,768,404.05	100.00

7.2 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	984,691.00	2.07
C	制造业	37,510,609.58	78.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,785,953.12	3.76
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,175,885.88	4.58
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	-	-
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	701,804.68	1.48
	合计	43,158,944.26	90.87

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股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	151,352	3,497,744.72	7.36
2	600438	通威股份	215,278	3,026,808.68	6.37
3	002594	比亚迪	59,059	2,995,472.48	6.31
4	002202	金风科技	174,033	2,163,230.19	4.55
5	600406	国电南瑞	105,040	1,957,945.60	4.12
6	300124	汇川技术	83,758	1,918,895.78	4.04
7	002466	天齐锂业	57,222	1,446,572.16	3.05
8	601985	中国核电	256,900	1,428,364.00	3.01
9	600089	特变电工	188,405	1,365,936.25	2.88
10	300207	欣旺达	106,899	1,231,476.48	2.59

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票信息，应阅读登载于

<http://www.yhfund.com.cn> 网站的半年度报告正文。

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	002594	比亚迪	4,940,790.00	11.51
2	300457	赢合科技	4,073,570.80	9.49
3	300316	晶盛机电	4,059,228.30	9.45
4	600406	国电南瑞	4,009,361.97	9.34

5	603659	璞泰来	3,924,357.00	9.14
6	002074	国轩高科	3,916,199.00	9.12
7	002709	天赐材料	3,889,119.00	9.06
8	002080	中材科技	3,887,952.60	9.06
9	002407	多氟多	3,859,343.00	8.99
10	300568	星源材质	3,737,773.00	8.71
11	300274	阳光电源	3,688,228.00	8.59
12	300443	金雷股份	3,605,450.05	8.40
13	002341	新纶科技	3,464,165.00	8.07
14	300073	当升科技	3,246,413.00	7.56
15	002202	金风科技	3,062,940.64	7.13
16	600438	通威股份	3,020,666.00	7.04
17	603799	华友钴业	3,017,312.80	7.03
18	601877	正泰电器	2,969,124.90	6.92
19	600580	卧龙电驱	2,478,360.00	5.77
20	600131	岷江水电	2,327,200.00	5.42
21	300340	科恒股份	2,323,276.24	5.41
22	603026	石大胜华	2,305,086.00	5.37
23	603507	振江股份	2,283,785.00	5.32
24	601012	隆基股份	2,072,529.52	4.83
25	002531	天顺风能	2,024,885.00	4.72
26	002850	科达利	1,949,865.00	4.54
27	300118	东方日升	1,927,617.64	4.49
28	300207	欣旺达	1,908,282.00	4.44
29	600312	平高电气	1,793,152.00	4.18
30	603218	日月股份	1,780,382.00	4.15
31	300450	先导智能	1,691,068.44	3.94
32	300124	汇川技术	1,489,632.00	3.47
33	002466	天齐锂业	1,371,520.00	3.19
34	300037	新宙邦	1,371,504.00	3.19
35	300750	宁德时代	1,278,268.00	2.98
36	300014	亿纬锂能	1,174,201.00	2.73
37	601985	中国核电	1,034,697.00	2.41

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	600406	国电南瑞	5,197,148.83	12.11
2	300274	阳光电源	5,172,191.78	12.05
3	002709	天赐材料	4,526,340.35	10.54
4	002594	比亚迪	4,352,038.40	10.14
5	300316	晶盛机电	4,335,007.66	10.10
6	002080	中材科技	4,310,330.50	10.04
7	002531	天顺风能	4,113,031.69	9.58
8	002407	多氟多	4,087,042.35	9.52
9	603507	振江股份	4,033,536.36	9.39
10	002341	新纶科技	3,932,650.61	9.16
11	300457	赢合科技	3,879,371.22	9.04
12	002074	国轩高科	3,667,929.38	8.54
13	300568	星源材质	3,617,923.98	8.43
14	300750	宁德时代	3,551,093.82	8.27
15	603659	璞泰来	3,441,054.92	8.01
16	300037	新宙邦	3,357,348.88	7.82
17	601877	正泰电器	3,001,791.61	6.99
18	300073	当升科技	2,988,565.13	6.96
19	603026	石大胜华	2,853,146.00	6.65
20	601012	隆基股份	2,849,606.00	6.64
21	300443	金雷股份	2,716,559.25	6.33
22	300124	汇川技术	2,544,652.97	5.93
23	603799	华友钴业	2,401,685.00	5.59
24	002202	金风科技	2,392,357.97	5.57
25	600312	平高电气	2,272,271.44	5.29
26	600580	卧龙电驱	2,214,677.00	5.16
27	300118	东方日升	2,209,901.34	5.15
28	300340	科恒股份	2,141,205.60	4.99
29	002850	科达利	2,102,989.24	4.90
30	300001	特锐德	1,897,979.24	4.42
31	300014	亿纬锂能	1,801,075.56	4.20
32	600131	岷江水电	1,613,408.00	3.76
33	000400	许继电气	1,393,950.34	3.25

34	300450	先导智能	1,303,731.38	3.04
35	600438	通威股份	1,275,480.20	2.97
36	002812	恩捷股份	1,151,458.95	2.68
37	603218	日月股份	952,977.80	2.22
38	300207	欣旺达	861,540.19	2.01

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	130,009,623.75
卖出股票收入（成交）总额	131,657,387.00

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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 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	19,459.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	958.58
5	应收申购款	153,723.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	174,141.48

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
银华新能源新材料量化股票发起式 A	1,554	22,372.24	10,002,000.20	28.77%	24,764,463.16	71.23%
银华新能源新材料量化股票发起式 C	1,655	17,999.29	0.00	0.00%	29,788,825.03	100.00%
合计	3,209	20,116.95	10,002,000.20	15.49%	54,553,288.19	84.51%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

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	银华新能源新材料量化股票发起式 A	65,883.32	0.19%
	银华新能源新材料量化股票发起式 C	33,442.24	0.11%

	合计	99,325.56	0.15%
--	----	-----------	-------

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的情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,000.20	15.49	10,002,000.20	15.49	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,000.20	15.49	10,002,000.20	15.49	3 年

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,002,000.20 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 2,000.20 份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华新能源新材料量化股票发起式 A	银华新能源新材料量化股票发起式 C
基金合同生效日（2017 年 9 月 15 日）基金份额总额	41,359,541.10	45,219,048.57
本报告期期初基金份额总额	35,751,744.01	28,951,021.00
本报告期期间基金总申购份额	16,018,562.75	20,511,498.39
减：本报告期期间基金总赎回份额	17,003,843.40	19,673,694.36
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,766,463.36	29,788,825.03

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			例			
东吴证券股份有限公司	2	124,437,006.13	47.60%	90,999.54	45.01%	-
国盛证券有限责任公司	2	33,011,844.95	12.63%	24,141.47	11.94%	-
广发证券股份有限公司	2	28,085,082.22	10.74%	20,537.94	10.16%	-
西藏东方财富证券股份有限公司	2	19,187,879.73	7.34%	17,869.72	8.84%	-
浙商证券股份有限公司	2	18,346,961.76	7.02%	13,417.38	6.64%	-
中信证券股份有限公司	1	13,237,213.12	5.06%	12,327.90	6.10%	-
瑞银证券有限责任公司	1	13,169,110.71	5.04%	12,264.40	6.07%	-
中泰证券股份有限公司	3	8,664,281.30	3.31%	8,069.15	3.99%	-
东北证券股份有限公司	2	2,616,710.39	1.00%	1,913.81	0.95%	-
方正证券股份有限公司	2	681,392.00	0.26%	634.64	0.31%	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西藏同信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增 1 个交易单元
爱建证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

（2）基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

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
东吴证券股份有限公司	-	-	5,000,000.00	100.00%	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-

§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

本基金管理人于 2019 年 6 月 27 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告》，本基金属于本基金管理人旗下可投资科创板股票的基金之一。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

银华基金管理股份有限公司

2019 年 8 月 26 日