

银华新能源新材料量化优选股票型发起式
证券投资基金
2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1 资产负债表.....	20
6.2 利润表.....	21
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22

6.4 报表附注.....	23
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65

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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 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	348,235,297.40 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	275,431,436.06 份	72,803,861.34 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	中证新能源指数收益率×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，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 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100738	100140
法定代表人		王珠林	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
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

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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	43,303,170.58	11,714,852.23
本期利润	106,109,977.35	31,670,358.95
加权平均基金份额本期利润	0.3693	0.3758
本期加权平均净值利润率	23.14%	23.97%
本期基金份额净值增长率	27.11%	26.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	68,014,716.84	16,392,475.37
期末可供分配基金份额利润	0.2469	0.2252
期末基金资产净值	545,147,910.84	141,740,631.96
期末基金份额净值	1.9793	1.9469
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	97.93%	94.69%

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	11.37%	2.02%	5.27%	1.35%	6.10%	0.67%
过去三个月	38.27%	1.93%	19.89%	1.27%	18.38%	0.66%
过去六个月	27.11%	2.31%	18.18%	1.72%	8.93%	0.59%
过去一年	102.28%	2.09%	69.03%	1.66%	33.25%	0.43%
过去三年	164.86%	1.77%	83.82%	1.47%	81.04%	0.30%
自基金合同	97.93%	1.67%	43.86%	1.41%	54.07%	0.26%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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	11.33%	2.02%	5.27%	1.35%	6.06%	0.67%
过去三个月	38.13%	1.92%	19.89%	1.27%	18.24%	0.65%
过去六个月	26.87%	2.31%	18.18%	1.72%	8.69%	0.59%
过去一年	101.46%	2.09%	69.03%	1.66%	32.43%	0.43%
过去三年	161.50%	1.77%	83.82%	1.47%	77.68%	0.30%
自基金合同生效起至今	94.69%	1.67%	43.86%	1.41%	50.83%	0.26%

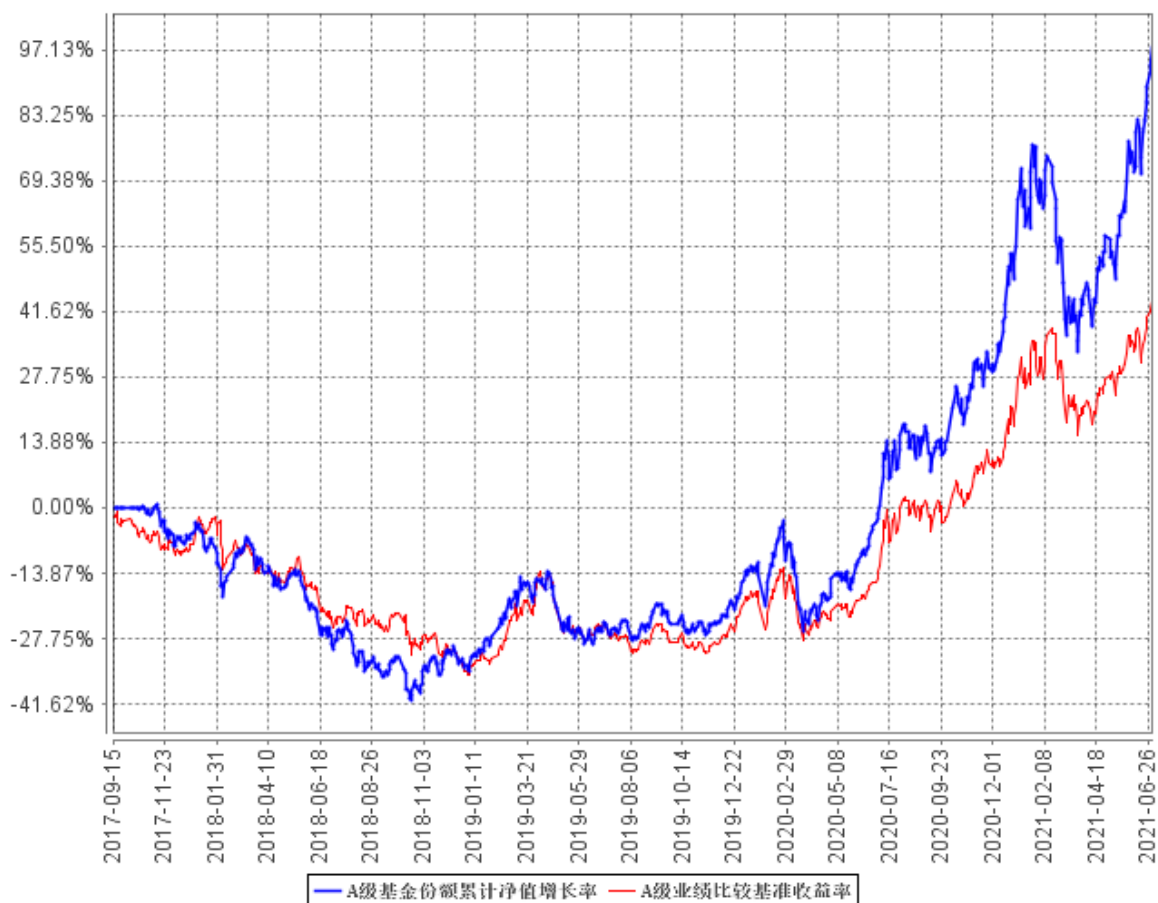
注：中证新能源指数收益率×45%+中证全指原材料指数收益率×45%+商业银行人民币活期存款利率（税后）×10%

本基金股票部分主要投资于新能源新材料主题的股票，包括新型能源和新型材料两个部分。中证新能源指数和中证全指原材料指数基本反应了沪深 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题具有较强的代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。

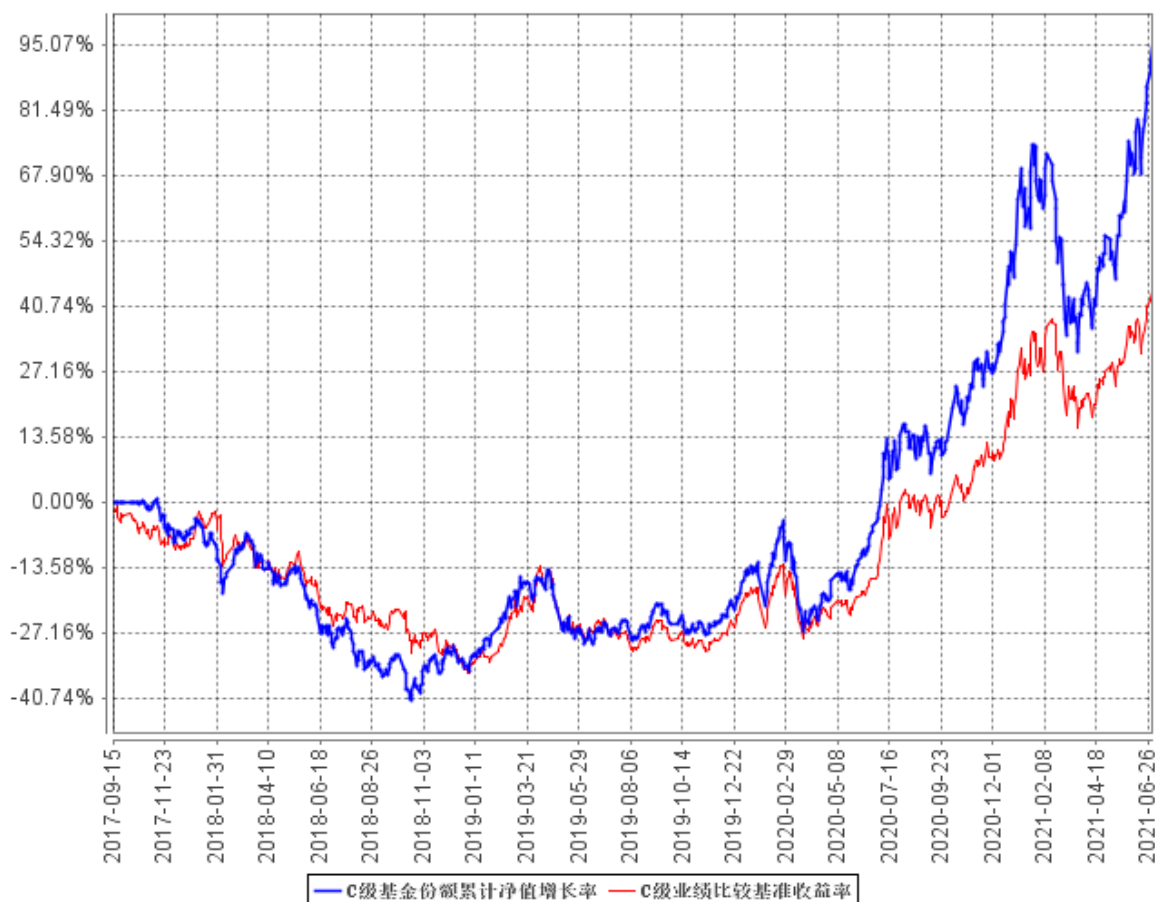
本基金为股票型基金，股票投资占基金资产的比例为 80% - 95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。故在业绩比较基准中给予投资主题相匹配的标的指数收益率 90% 的权重，相应将 10% 作为体现现金或到期日在一年以内的政府债券业绩表现的权重。

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%。

§ 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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 149 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 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、银华积极精选混合型证券投资基金、银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、银华兴盛股票型证券投资基金、银华尊享稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金、银华尊享养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华尊享养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、银华丰华三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银华稳晟

39 个月定期开放债券型证券投资基金、银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金、银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金、银华大盘精选两年定期开放混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、银华科技创新混合型证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金、银华信用精选 18 个月定期开放债券型证券投资基金、银华永盛债券型证券投资基金、银华汇盈一年持有期混合型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、银华长丰混合型发起式证券投资基金、银华港股通精选股票型发起式证券投资基金、银华丰享一年持有期混合型证券投资基金、银华沪深股通精选混合型证券投资基金、银华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华同力精选混合型证券投资基金、银华富利精选混合型证券投资基金、银华创业板两年定期开放混合型证券投资基金、银华汇益一年持有期混合型证券投资基金、银华多元机遇混合型证券投资基金、银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、银华品质消费股票型证券投资基金、银华招利一年持有期混合型证券投资基金、银华信用精选 15 个月定期开放债券型证券投资基金、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、银华长江经济带主题债券型证券投资基金、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、银华中证 800 汽车与零部件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。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	-	7 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

				<p>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 日起兼任银华中证影</p>
--	--	--	--	--

					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 日起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 日起兼任银华中证 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。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	-	8.5 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。
谭跃峰先生	本基金的基金经理助理	2020 年 1 月 10 日	-	9.5 年	学士学位，曾就职于交通银行股份有限公司北京分公司。2012 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部助理量化研究员，现任基金经理助理。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。

3、自 2021 年 7 月 30 日起刘文魁先生开始担任本基金基金经理助理职务。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华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，原因是量化投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，随着全球疫苗接种的逐步展开，新冠疫情的阴影正在全球范围内逐步减弱。全球经济复苏的预期有所上升，在利率、贵金属等资产价格的波动上有所反应。这种波动也反过来对权益市场的估值产生了一定的影响。A 股市场在春节后大幅调整，随后在二季度中强劲反弹，大消费类行业表现回暖，周期资源类行业、科技类行业出现了大幅反弹。上半年创业板上涨 17.22%，沪深 300 上涨 0.24%。新能源新材料相关行业中，汽车板块上涨 11.22%，有色板块上涨 15.34%，电力设备板块上涨 24.32%。

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 1.9793 元，本报告期基

金份额净值增长率为 27.11%；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 1.9469 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.87%；同期业绩比较基准收益率为 18.18%。

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，新能源板块的基本面依旧稳中向好，前期受到通胀变化和利率上行的影响，市场引发的对新能源产业链利润及板块估值的担忧，也随着半年报高增长预期而得到了一定程度的消化。发展新能源汽车是目前全球主要经济体的共识，拜登政府宣布 2026 年美国汽车市场电动化率达到 25%，中国与欧美新能源车市场在下半年将进入加速放量的阶段，目前渗透率已经达到了两位数。光伏产业链方面，2021 年是国内光伏和陆上风电平价的元年，项目储备充足，进入后补贴时代，原料价格有见顶迹象，利好产业链长期健康发展；此外国家能源局近期发布的整县屋顶分布式装机规划进一步打开了光伏领域市场空间。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，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银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金 2021 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	64,757,745.16	85,441,395.52
结算备付金		697,344.72	571,290.85
存出保证金		154,197.58	23,572.32
交易性金融资产	6.4.7.2	629,896,185.87	381,073,473.19
其中：股票投资		629,896,185.87	381,073,473.19
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,612,202.20	-
应收利息	6.4.7.5	7,434.64	8,102.67
应收股利		-	-
应收申购款		25,674,025.95	6,749,549.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		722,799,136.12	473,867,384.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		-	16,185,395.42
应付赎回款		34,461,405.69	18,104,521.00
应付管理人报酬		526,447.66	185,612.90
应付托管费		52,644.75	18,561.28
应付销售服务费		45,689.84	22,873.04
应付交易费用	6.4.7.7	705,691.85	382,525.84
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	118,713.53	168,287.21
负债合计		35,910,593.32	35,067,776.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	348,235,297.40	282,858,925.46
未分配利润	6.4.7.10	338,653,245.40	155,940,682.13
所有者权益合计		686,888,542.80	438,799,607.59
负债和所有者权益总计		722,799,136.12	473,867,384.28

注：报告截止日 2021 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 1.9793 元，基金份额总额 275,431,436.06 份；银华新能源新材料量化股票发起式 C 基金份额净值 1.9469 元，基金份额总额 72,803,861.34 份。银华新能源新材料量化股票发起式份额总额合计为 348,235,297.40 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		143,807,826.44	9,354,372.20
1.利息收入		123,901.47	13,042.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	123,901.47	13,042.38
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		53,998,180.25	4,347,559.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	52,141,806.10	4,010,662.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,856,374.15	336,897.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	82,762,313.49	4,918,016.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,923,431.23	75,753.93
减：二、费用		6,027,490.14	667,998.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,939,892.60	232,469.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	293,989.19	23,246.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	263,407.47	43,765.70
4. 交易费用	6.4.7.19	2,441,416.77	317,668.25
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	6.4.7.20	88,784.11	50,848.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		137,780,336.30	8,686,373.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		137,780,336.30	8,686,373.44

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	282,858,925.46	155,940,682.13	438,799,607.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	137,780,336.30	137,780,336.30
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）	65,376,371.94	44,932,226.97	110,308,598.91
其中：1.基金申购款	887,899,389.62	569,556,215.41	1,457,455,605.03
2.基金赎回款	-822,523,017.68	-524,623,988.44	-1,347,147,006.12
四、本期向基金份额持	-	-	-

有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	348,235,297.40	338,653,245.40	686,888,542.80
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	53,543,975.92	-9,792,064.83	43,751,911.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,686,373.44	8,686,373.44
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）	7,154,874.93	-600,138.64	6,554,736.29
其中：1.基金申购款	43,687,052.14	-5,430,603.21	38,256,448.93
2.基金赎回款	-36,532,177.21	4,830,464.57	-31,701,712.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	60,698,850.85	-1,705,830.03	58,993,020.82

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

银华新能源新材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】910号文《关于准予银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金注册的批复》准予募集注册并公开发行,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》及有关规定和《银华新能源新材料量化

《银华新能源新材料量化股票发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发起,于 2017 年 8 月 14 日至 2017 年 9 月 8 日向社会公开募集。本基金根据销售服务费、赎回费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限为不定期。募集期间净认购资金总额为人民币 86,557,464.71 元(其中,A 类份额认购有效净认购资金为人民币 41,349,621.32 元,折算成基金份额计 41,349,621.32 份;C 类份额认购有效净认购资金为人民币 45,207,843.39 元,折算成基金份额计 45,207,843.39 份),在募集期间产生的利息为人民币 21,124.96 元(其中,A 类份额认购有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 9,919.78 元,折算成基金份额计 9,919.78 份;C 类份额认购有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 11,205.18 元,折算成基金份额计 11,205.18 份),以上实收基金(本息)合计为人民币 86,578,589.67 元,折合 86,578,589.67 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所验证。经向中国证监会备案后,基金合同于 2017 年 9 月 15 日生效。本基金的基金管理人和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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围是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)、资产支持证券、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(权证、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);本基金的投资组合比例为: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%。本基金的业绩比较基准是:中证新能源指数收益率 \times 45%+中证全指原材料指数收益率 \times 45%+商业银行人民币活期存款利率(税后) \times 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称

“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间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

本基金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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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;公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,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，受让方不再缴纳印花税；

(5)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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	64,757,745.16
定期存款	-
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	-
合计：	64,757,745.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	490,681,146.99	629,896,185.87	139,215,038.88
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	490,681,146.99	629,896,185.87	139,215,038.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	7,051.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	313.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	69.40
合计	7,434.64

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	705,691.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	705,691.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	36,890.67
应付证券出借违约金	-
预提费用	81,822.86
合计	118,713.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银华新能源新材料量化股票发起式 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,249,825.58	210,249,825.58
本期申购	693,733,402.01	693,733,402.01
本期赎回(以“-”号填列)	-628,551,791.53	-628,551,791.53
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	275,431,436.06	275,431,436.06

金额单位：人民币元

银华新能源新材料量化股票发起式 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,609,099.88	72,609,099.88
本期申购	194,165,987.61	194,165,987.61
本期赎回(以“-”号填列)	-193,971,226.15	-193,971,226.15
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	72,803,861.34	72,803,861.34

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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

银华新能源新材料量化股票发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,586,314.81	99,534,181.93	117,120,496.74
本期利润	43,303,170.58	62,806,806.77	106,109,977.35
本期基金份额交易产生的变动数	7,125,231.45	39,360,769.24	46,486,000.69
其中：基金申购款	108,047,477.62	341,454,908.95	449,502,386.57
基金赎回款	-100,922,246.17	-302,094,139.71	-403,016,385.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,014,716.84	201,701,757.94	269,716,474.78

单位：人民币元

银华新能源新材料量化股票发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,903,533.24	33,916,652.15	38,820,185.39
本期利润	11,714,852.23	19,955,506.72	31,670,358.95
本期基金份额交易产生的变动数	-225,910.10	-1,327,863.62	-1,553,773.72
其中：基金申购款	27,080,685.69	92,973,143.15	120,053,828.84
基金赎回款	-27,306,595.79	-94,301,006.77	-121,607,602.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,392,475.37	52,544,295.25	68,936,770.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	110,649.36
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	12,278.51
其他	973.60
合计	123,901.47

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	847,639,178.80
减：卖出股票成本总额	795,497,372.70
买卖股票差价收入	52,141,806.10

6.4.7.13 债券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,856,374.15
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	1,856,374.15

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	82,762,313.49
——股票投资	82,762,313.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	82,762,313.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	6,868,785.84
转换费收入 005037	44,854.44
转换费收入 005038	9,790.95
合计	6,923,431.23

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	2,441,416.77
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,441,416.77

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021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	6,961.25
合计	88,784.11

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

本基金管理人于 2021 年 6 月 17 日发布《银华基金管理股份有限公司关于银华国际资本管理有限公司增加注册资本的公告》，银华基金管理股份有限公司（以下简称“母公司”）已完成对银华国际资本管理有限公司（以下简称“香港子公司”）的增资工作，母公司向香港子公司增加注册资本金共港币 7,000 万元。增资完成后，母公司维持持股比例 100%，共持股 1 亿股，香港子公司注册资本为 1 亿元港币。

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
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
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

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。

6.4.10 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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付	2,939,892.60	232,469.68

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	1,160,539.35	94,722.09

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	293,989.19	23,246.96

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。

6.4.10.2.3 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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
第一创业	-	414.15	414.15
西南证券	-	233.39	233.39
中国工商银行	-	40,732.88	40,732.88

银华基金管理股份有限公司	-	6,754.01	6,754.01
合计	-	48,134.43	48,134.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	27,426.82	27,426.82
银华基金管理股份有限公司	-	628.31	628.31
合计	-	28,055.13	28,055.13

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。

6.4.10.3 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

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 2021年1月1日至2021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	-	-

报告期初持有的基金份额	10,002,000.20	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,000.20	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.63%	-

项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,000.20	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,000.20	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	36.00%	-

- 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固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。

6.4.10.5.2 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	64,757,745.16	110,649.36	8,369,343.90	11,697.82

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（2021 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	可流通日	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
688665	四方光电	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新发流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	
688613	奥精医疗	2021 年 5 月 13 日	2021 年 11 月 21 日	新发流通受限	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	
688059	华锐精密	2021 年 2 月 1 日	2021 年 8 月 8 日	新发流通受限	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	
688097	博众精工	2021 年 4 月 29 日	2021 年 11 月 12 日	新发流通受限	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新发流通受限	47.33	251.96	380	17,985.40	95,744.80	
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 1 日	新发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	
688191	智洋创新	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 8 日	新发流通受限	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	

300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新发流通受限	33.22	87.50	569	18,902.18	49,787.50	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新发流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新发流通受限	28.28	115.71	357	10,095.96	41,308.47	-
688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月13日	新发流通受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新发流通受限	48.59	90.39	301	14,625.59	27,207.39	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新发流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新发流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新发流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新发流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新发流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新发流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新发流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新发流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新发流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新发流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-

300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新发流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新发流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新发流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新发流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新发流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新发流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新发流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月20日	新发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新发流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月	新发流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-

		日	月 21 日							
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新发流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立 科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新发流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖 智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新发流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新发流 通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰 生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新发流 通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新发流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德 新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新发流 通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新发流 通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波 方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新发流 通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电 科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新发流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪 节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新发流 通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

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

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.12.5 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。

6.4.12.6 信用风险

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

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

6.4.12.7 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。

6.4.12.7.1 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 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同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.12.8 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。

6.4.12.8.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和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。

6.4.12.8.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	64,757,745.16	-	-	-	-	-	64,757,745.16
结算备付金	697,344.72	-	-	-	-	-	697,344.72
存出保证金	154,197.58	-	-	-	-	-	154,197.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	629,896,185.87	629,896,185.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,612,202.20	1,612,202.20
应收利息	-	-	-	-	-	7,434.64	7,434.64
应收申购款	-	-	-	-	-	25,674,025.95	25,674,025.95
资产总计	65,609,287.46	-	-	-	-	657,189,848.66	722,799,136.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,461,405.69	34,461,405.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	526,447.66	526,447.66
应付托管费	-	-	-	-	-	52,644.75	52,644.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	45,689.84	45,689.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	705,691.85	705,691.85
其他负债	-	-	-	-	-	118,713.53	118,713.53
负债总计	-	-	-	-	-	35,910,593.32	35,910,593.32
利率敏感度缺口	65,609,287.46	-	-	-	-	621,279,255.34	686,888,542.80
上年度末 2020年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	85,441,395.52	-	-	-	-	-	85,441,395.52
结算备付金	571,290.85	-	-	-	-	-	571,290.85
存出保证金	23,572.32	-	-	-	-	-	23,572.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	381,073,473.19	381,073,473.19
应收利息	-	-	-	-	-	8,102.67	8,102.67
应收申购款	23,200.00	-	-	-	-	6,726,349.73	6,749,549.73
资产总计	86,059,458.69	-	-	-	-	387,807,925.59	473,867,384.28
负债							
应付证券清算	-	-	-	-	-	16,185,395.42	16,185,395.42

款							
应付赎回款		-	-	-	-	18,104,521.00	18,104,521.00
应付管理人报酬		-	-	-	-	185,612.90	185,612.90
应付托管费		-	-	-	-	18,561.28	18,561.28
应付销售服务费		-	-	-	-	22,873.04	22,873.04
应付交易费用		-	-	-	-	382,525.84	382,525.84
其他负债		-	-	-	-	168,287.21	168,287.21
负债总计		-	-	-	-	35,067,776.69	35,067,776.69
利率敏感度缺口	86,059,458.69	-	-	-	-	-352,740,148.90	438,799,607.59

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.12.8.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.12.8.2 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。

6.4.12.8.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	629,896,185.87	91.70	381,073,473.19	86.84
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	629,896,185.87	91.70	381,073,473.19	86.84

6.4.12.8.2.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	32,354,233.69	18,520,155.60
	业绩比较基准下降 5%	-32,354,233.69	-18,520,155.60

6.4.13 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	629,896,185.87	87.15
	其中：股票	629,896,185.87	87.15
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	65,455,089.88	9.06
8	其他各项资产	27,447,860.37	3.80
9	合计	722,799,136.12	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	3,988,200.09	0.58
C	制造业	617,466,263.35	89.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,206,457.81	0.32
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	28,465.12	0.00
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	4,680,209.85	0.68
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	7,136.28	0.00
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	1,448,070.62	0.21
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	629,896,185.87	91.70

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	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	126,600	67,705,680.00	9.86
2	601012	隆基股份	616,171	54,740,631.64	7.97
3	300014	亿纬锂能	368,143	38,261,101.99	5.57
4	603799	华友钴业	278,229	31,773,751.80	4.63
5	002460	赣锋锂业	252,065	30,522,550.85	4.44
6	600438	通威股份	540,206	23,374,713.62	3.40
7	300450	先导智能	307,502	18,493,170.28	2.69
8	300274	阳光电源	160,037	18,413,857.22	2.68
9	603659	璞泰来	132,799	18,140,343.40	2.64
10	002709	天赐材料	163,914	17,469,954.12	2.54
11	300037	新宙邦	148,360	14,850,836.00	2.16
12	300073	当升科技	200,098	11,243,506.62	1.64
13	002340	格林美	1,173,321	10,970,551.35	1.60
14	300763	锦浪科技	59,775	10,795,365.00	1.57
15	603806	福斯特	101,945	10,717,477.85	1.56
16	600563	法拉电子	62,304	9,866,461.44	1.44
17	300124	汇川技术	127,413	9,461,689.38	1.38
18	002407	多氟多	258,443	9,185,064.22	1.34
19	002129	中环股份	210,291	8,117,232.60	1.18
20	601689	拓普集团	210,549	7,880,849.07	1.15
21	002812	恩捷股份	32,426	7,590,926.60	1.11
22	002050	三花智控	309,041	7,410,803.18	1.08
23	688116	天奈科技	58,524	6,905,832.00	1.01

24	688390	固德威	20,599	6,880,066.00	1.00
25	300724	捷佳伟创	57,605	6,682,756.05	0.97
26	600884	杉杉股份	273,017	6,366,756.44	0.93
27	600309	万华化学	54,552	5,936,348.64	0.86
28	688005	容百科技	46,265	5,607,318.00	0.82
29	002497	雅化集团	234,900	5,351,022.00	0.78
30	603218	日月股份	184,405	4,993,687.40	0.73
31	000301	东方盛虹	235,300	4,917,770.00	0.72
32	600885	宏发股份	75,764	4,750,402.80	0.69
33	300496	中科创达	29,306	4,602,800.36	0.67
34	688339	亿华通	15,666	4,428,778.20	0.64
35	300316	晶盛机电	87,674	4,427,537.00	0.64
36	300919	中伟股份	26,444	4,310,372.00	0.63
37	003022	联泓新科	140,360	4,309,052.00	0.63
38	688006	杭可科技	50,260	4,272,100.00	0.62
39	002466	天齐锂业	64,170	3,979,823.40	0.58
40	688208	道通科技	45,611	3,967,700.89	0.58
41	300568	星源材质	92,949	3,845,300.13	0.56
42	601233	桐昆股份	152,110	3,664,329.90	0.53
43	002594	比亚迪	14,014	3,517,514.00	0.51
44	300699	光威复材	44,285	3,363,445.75	0.49
45	600176	中国巨石	216,319	3,355,107.69	0.49
46	601899	紫金矿业	345,144	3,344,445.36	0.49
47	600426	华鲁恒升	99,001	3,064,080.95	0.45
48	601633	长城汽车	69,801	3,042,625.59	0.44
49	300408	三环集团	68,021	2,885,450.82	0.42
50	600346	恒力石化	99,560	2,612,454.40	0.38
51	002850	科达利	29,505	2,578,737.00	0.38
52	600660	福耀玻璃	44,757	2,499,678.45	0.36
53	300751	迈为股份	5,493	2,497,667.10	0.36
54	002643	万润股份	135,172	2,403,358.16	0.35
55	603185	上机数控	12,673	2,267,833.35	0.33
56	600549	厦门钨业	108,865	2,267,657.95	0.33
57	601985	中国核电	434,407	2,198,099.42	0.32
58	300001	特锐德	70,157	2,112,427.27	0.31
59	002271	东方雨虹	35,782	1,979,460.24	0.29
60	601311	骆驼股份	170,500	1,972,685.00	0.29
61	002648	卫星石化	48,962	1,918,820.78	0.28
62	600089	特变电工	140,567	1,806,285.95	0.26

63	002459	晶澳科技	36,684	1,797,516.00	0.26
64	600862	中航高科	55,213	1,699,456.14	0.25
65	000049	德赛电池	35,071	1,609,758.90	0.23
66	601966	玲珑轮胎	35,735	1,563,048.90	0.23
67	002254	泰和新材	76,600	1,552,682.00	0.23
68	601222	林洋能源	185,034	1,533,931.86	0.22
69	002240	盛新锂能	53,390	1,524,284.50	0.22
70	600732	爱旭股份	108,363	1,508,412.96	0.22
71	603267	鸿远电子	11,466	1,466,730.72	0.21
72	600499	科达制造	98,500	1,418,400.00	0.21
73	603179	新泉股份	42,767	1,406,178.96	0.20
74	000035	中国天楹	303,342	1,383,239.52	0.20
75	002756	永兴材料	22,328	1,326,059.92	0.19
76	601100	恒立液压	15,390	1,322,308.80	0.19
77	601865	福莱特	32,010	1,265,355.30	0.18
78	002064	华峰化学	84,520	1,200,184.00	0.17
79	300618	寒锐钴业	15,083	1,189,143.72	0.17
80	603308	应流股份	55,882	1,153,963.30	0.17
81	000708	中信特钢	52,000	1,083,680.00	0.16
82	002623	亚玛顿	25,498	1,078,310.42	0.16
83	601058	赛轮轮胎	106,604	1,064,973.96	0.16
84	600110	诺德股份	83,991	1,023,010.38	0.15
85	002493	荣盛石化	57,256	988,811.12	0.14
86	300596	利安隆	21,600	935,928.00	0.14
87	300457	赢合科技	43,788	869,629.68	0.13
88	601168	西部矿业	53,961	643,754.73	0.09
89	300438	鹏辉能源	25,667	587,774.30	0.09
90	002080	中材科技	20,874	546,272.58	0.08
91	300777	中简科技	11,711	529,102.98	0.08
92	603260	合盛硅业	6,157	473,534.87	0.07
93	002531	天顺风能	54,194	468,778.10	0.07
94	002171	楚江新材	50,841	443,841.93	0.06
95	300769	德方纳米	2,000	413,380.00	0.06
96	600989	宝丰能源	25,900	354,312.00	0.05
97	600151	航天机电	34,625	339,325.00	0.05
98	002665	首航高科	140,400	303,264.00	0.04
99	002371	北方华创	984	272,941.92	0.04
100	002202	金风科技	20,761	252,453.76	0.04
101	002409	雅克科技	2,900	234,900.00	0.03

102	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.03
103	300395	菲利华	3,900	188,058.00	0.03
104	002139	拓邦股份	10,400	187,096.00	0.03
105	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.02
106	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.02
107	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.02
108	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.02
109	300957	贝泰妮	380	95,744.80	0.01
110	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
111	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.01
112	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
113	300979	华利集团	569	49,787.50	0.01
114	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
115	300973	立高食品	357	41,308.47	0.01
116	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.01
117	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
118	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
119	300981	中红医疗	301	27,207.39	0.00
120	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
121	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
122	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
123	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
124	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
125	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
126	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
127	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
128	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
129	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
130	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
131	300925	法本信息	396	10,410.84	0.00
132	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
133	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
134	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
135	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
136	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
137	300918	南山智尚	872	9,077.52	0.00
138	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
139	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
140	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00

141	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
142	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
143	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
144	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
145	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
146	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
147	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
148	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
149	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
150	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
151	300917	特发服务	258	7,136.28	0.00
152	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
153	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
154	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
155	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
156	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
157	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
158	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
159	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
160	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
161	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
162	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
163	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
164	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
165	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
166	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
167	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	601012	隆基股份	39,483,945.66	9.00
2	002460	赣锋锂业	35,513,199.97	8.09
3	300014	亿纬锂能	30,741,375.39	7.01
4	603799	华友钴业	29,076,196.86	6.63
5	002709	天赐材料	26,362,654.23	6.01

6	300750	宁德时代	26,035,980.20	5.93
7	300037	新宙邦	23,937,762.00	5.46
8	600438	通威股份	22,803,021.87	5.20
9	300450	先导智能	21,002,817.76	4.79
10	688006	杭可科技	19,998,755.50	4.56
11	603659	璞泰来	18,248,649.95	4.16
12	002812	恩捷股份	16,597,433.00	3.78
13	300763	锦浪科技	16,104,460.00	3.67
14	300073	当升科技	15,756,028.07	3.59
15	300751	迈为股份	15,608,533.00	3.56
16	688388	嘉元科技	15,565,165.59	3.55
17	603806	福斯特	14,864,934.37	3.39
18	601689	拓普集团	13,948,810.18	3.18
19	600563	法拉电子	13,543,219.33	3.09
20	002050	三花智控	12,609,315.05	2.87
21	600884	杉杉股份	12,542,931.56	2.86
22	002340	格林美	12,511,210.62	2.85
23	300124	汇川技术	12,086,666.18	2.75
24	002129	中环股份	11,894,843.96	2.71
25	300274	阳光电源	11,869,103.31	2.70
26	600732	爱旭股份	11,696,672.00	2.67
27	600309	万华化学	10,831,302.64	2.47
28	600660	福耀玻璃	10,802,738.13	2.46
29	300724	捷佳伟创	10,617,204.00	2.42
30	002594	比亚迪	9,722,089.00	2.22
31	300316	晶盛机电	9,677,722.40	2.21
32	002080	中材科技	9,622,939.12	2.19
33	300207	欣旺达	9,503,278.90	2.17
34	002850	科达利	9,452,218.90	2.15
35	300118	东方日升	9,328,743.16	2.13
36	603218	日月股份	9,193,366.67	2.10
37	600089	特变电工	9,101,381.12	2.07

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 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	600438	通威股份	27,770,152.96	6.33
2	601012	隆基股份	26,331,047.89	6.00
3	002709	天赐材料	25,686,824.96	5.85
4	300450	先导智能	21,509,765.84	4.90
5	603799	华友钴业	20,881,121.34	4.76
6	300274	阳光电源	17,930,531.05	4.09
7	002460	赣锋锂业	17,256,853.68	3.93
8	603659	璞泰来	16,129,151.40	3.68
9	002812	恩捷股份	15,908,474.93	3.63
10	300751	迈为股份	15,864,239.54	3.62
11	300037	新宙邦	15,732,473.63	3.59
12	300207	欣旺达	15,518,260.27	3.54
13	603806	福斯特	15,124,729.10	3.45
14	002202	金风科技	14,100,121.54	3.21
15	300014	亿纬锂能	13,790,310.46	3.14
16	300316	晶盛机电	13,605,577.59	3.10
17	002594	比亚迪	13,443,545.62	3.06
18	300763	锦浪科技	13,430,026.03	3.06
19	002080	中材科技	13,259,884.68	3.02
20	300750	宁德时代	13,259,083.26	3.02
21	300073	当升科技	12,705,988.82	2.90
22	300124	汇川技术	11,922,360.24	2.72
23	002050	三花智控	11,893,467.03	2.71
24	002129	中环股份	11,665,376.59	2.66
25	000690	宝新能源	11,274,196.34	2.57
26	600885	宏发股份	11,167,700.69	2.55
27	300724	捷佳伟创	11,160,636.93	2.54
28	603218	日月股份	10,844,715.32	2.47
29	601222	林洋能源	10,330,213.81	2.35
30	600732	爱旭股份	10,068,529.25	2.29
31	601689	拓普集团	9,957,854.38	2.27
32	600089	特变电工	9,545,775.84	2.18
33	002074	国轩高科	9,056,488.81	2.06
34	600884	杉杉股份	8,972,183.89	2.04

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	977,298,337.22
卖出股票收入（成交）总额	847,639,178.80

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 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受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券包括华友钴业（证券代码：603799）。

公司因违反《上市公司信息披露管理办法》，于 2020 年 12 月 30 日收到中国证券监督管理委员会浙江监管局下发的《关于对浙江华友钴业股份有限公司采取责令改正措施的决定》。

上述处罚信息公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和视为，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	154,197.58
2	应收证券清算款	1,612,202.20
3	应收股利	-
4	应收利息	7,434.64
5	应收申购款	25,674,025.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,447,860.37

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	121,374	2,269.28	10,061,076.11	3.65%	265,370,359.95	96.35%
银华新能源新材料量化股票发起式 C	17,011	4,279.81	-	0.00%	72,803,861.34	100.00%
合计	138,385	2,516.42	10,061,076.11	2.89%	338,174,221.29	97.11%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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	银华新能源新材料量化股票发起式 A	102,008.56	0.04%
	银华新能源新材料量化股票发起式 C	9,224.19	0.01%
	合计	111,232.75	0.03%

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

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	银华新能源新材料量化股票发起式 A	0
	银华新能源新材料量化股票发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银华新能源新材料量化股票发起式 A	0~10
	银华新能源新材料量化股票发起式 C	0
	合计	0~10

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	2.87	10,002,000.20	2.87	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	2.87	10,002,000.20	2.87	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	210,249,825.58	72,609,099.88
本报告期基金总申购份额	693,733,402.01	194,165,987.61
减：本报告期基金总赎回份额	628,551,791.53	193,971,226.15
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	275,431,436.06	72,803,861.34

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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

本基金管理人于 2021 年 1 月 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 29 日起在投资范围中增加存托凭证，并在投资策略中增加存托凭证相关投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券股份有限公司	2	1,042,662,134.48	57.85%	762,499.91	53.92%	-
中信证券股份有限公司	1	466,075,576.66	25.86%	434,057.37	30.69%	-
国盛证券股份有限公司	2	278,848,040.37	15.47%	203,920.09	14.42%	-

招商证券股份有限公司	1	14,740,191.29	0.82%	13,727.52	0.97%	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏同信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股	4	-	-	-	-	-

份有限公司						
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-

东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末运用交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

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	《银华基金管理股份有限公司关于银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金在大同证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告》	本基金管理人网站, 证券日报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 15 日
2	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021 年 1 月 20 日
3	《银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金 2020 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	2021 年 1 月 20 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》	本基金管理人网站, 四大证券报, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 29 日
5	《银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书(2021 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	2021 年 1 月 29 日
6	《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	2021 年 1 月 29 日
7	《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(2021 年 1 月修	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 29 日

	订》》		
8	《银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议（2021 年 1 月修订）》	本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 29 日
9	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告》	四大证券报	2021 年 3 月 29 日
10	《银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金 2020 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	2021 年 3 月 29 日
11	《银华基金管理股份有限公司关于银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金增加华金证券股份有限公司为代销机构的公告》	本基金管理人网站， 证券日报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 7 日
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告》	四大证券报	2021 年 4 月 21 日
13	《银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金 2021 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	2021 年 4 月 21 日
14	《银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 2 号）》	本基金管理人网站， 中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 23 日
15	《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	2021 年 4 月 23 日
16	《银华基金管理股份有限公司关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告》	本基金管理人网站， 四大证券报，中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 11 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

本基金管理人于 2021 年 1 月 29 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》，本基金自 2021 年 1 月 29 日起增加侧袋机制，在投资范围中增加存托凭证，并对基金合同及托管协议的相应条款进行了修订。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 银华新能源新材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 《银华新能源新材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》

12.1.4 《银华新能源新材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

2021 年 8 月 28 日