

---

银华文体娱乐量化优选股票型发起式证  
券投资基金  
2020 年中期报告

2020 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：2020 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 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40

7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59



## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	银华文体娱乐量化股票发起式	
基金主代码	005239	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年11月9日	
基金管理人	银华基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	30,744,701.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	银华文体娱乐量化股票发起式 A	银华文体娱乐量化股票发起式 C
下属分级基金的交易代码:	005239	005240
报告期末下属分级基金的份额总额	16,074,594.87份	14,670,106.76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，重点投资于具有竞争优势的本基金定义的文体娱乐主题相关的股票，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。	
投资策略	本基金投资于文体娱乐主题，使用主动量化策略对文体娱乐主题界定内的股票进行筛选并进行权重的优化，力争在跟踪文体娱乐主题整体市场表现的同时，获得相对于业绩比较基准的超额收益。本基金债券投资的主要目的是风险防御及现金替代性管理。债券投资将坚持安全性、流动性和收益性作为资产配置原则，采取久期调整策略、类属配置策略、收益率曲线策略，以兼顾投资组合的安全性、收益性与流动性。本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为80%-95%；投资于文体娱乐主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。	
业绩比较基准	中证文体指数收益率×90%+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。	
	银华文体娱乐量化股票发起式 A	银华文体娱乐量化股票发起式 C

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

## 2.5 其他相关资料

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	银华文体娱乐量化股票发起式 A	银华文体娱乐量化股票发起式 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	414,722.08	186,891.38
本期利润	1,717,063.26	667,688.73
加权平均基金份额本期利润	0.1164	0.0955
本期加权平均净值利润率	13.45%	10.93%
本期基金份额净值增长率	14.76%	14.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	-3,444,524.08	-3,086,436.65
期末可供分配基金份额利润	-0.2143	-0.2104
期末基金资产净值	15,649,380.13	14,349,244.19
期末基金份额净值	0.9735	0.9781
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-2.65%	-2.19%

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

#### 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

银华文体娱乐量化股票发起式 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	14.23%	1.12%	13.60%	1.07%	0.63%	0.05%
过去三个月	22.15%	1.28%	24.67%	1.28%	-2.52%	0.00%
过去六个月	14.76%	1.85%	15.32%	1.87%	-0.56%	-0.02%
过去一年	34.52%	1.55%	26.01%	1.53%	8.51%	0.02%
自基金合同生效起至今	-2.65%	1.56%	-10.70%	1.52%	8.05%	0.04%

银华文体娱乐量化股票发起式 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	14.20%	1.12%	13.60%	1.07%	0.60%	0.05%
过去三个月	22.02%	1.28%	24.67%	1.28%	-2.65%	0.00%
过去六个月	14.60%	1.85%	15.32%	1.87%	-0.72%	-0.02%
过去一年	34.45%	1.55%	26.01%	1.53%	8.44%	0.02%
自基金合同生效起至今	-2.19%	1.56%	-10.70%	1.52%	8.51%	0.04%

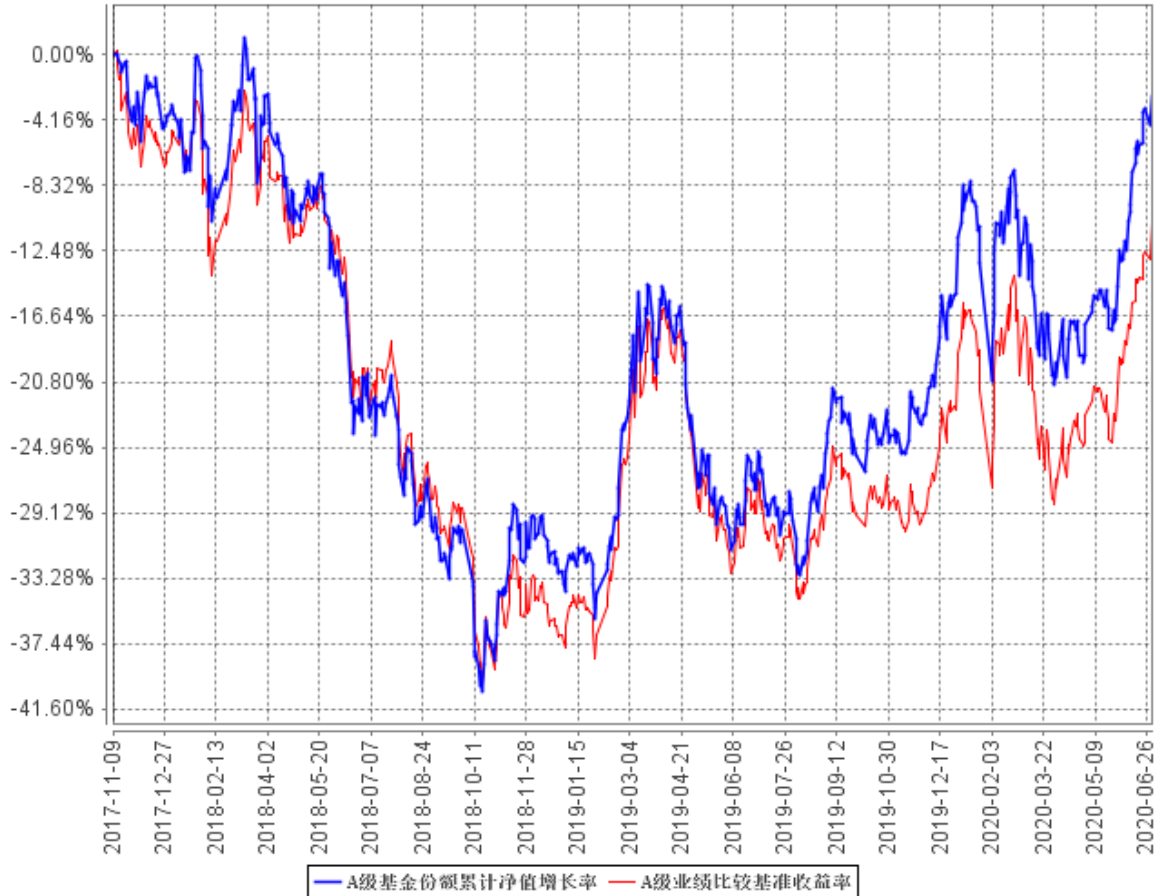
注：本基金的业绩比较基准为：中证文体指数收益率\*90%+商业银行人民币活期存款利率（税后）\*10%。

本基金股票部分主要投资于文体娱乐主题的股票。中证文体指数基本反映了沪深 A 股中文化教育、体育娱乐等公司股票的整体表现，对本基金定义的文体娱乐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。

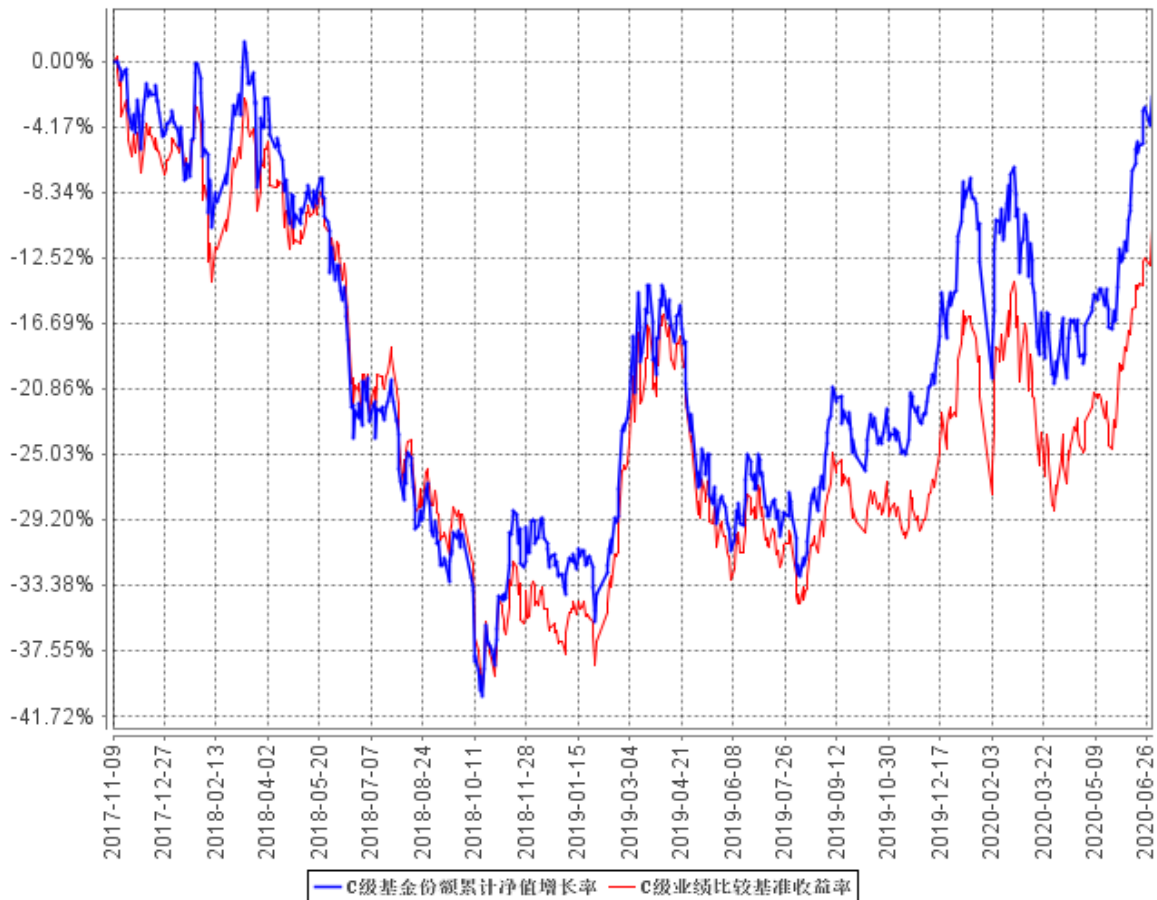
本基金为股票型基金，股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需要缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。故在业绩比较基准中给予投资主题相匹配的标的指数收益率 90% 的权重，相应将 10% 作为体现现金或到期日在一年以内的政府债券业绩表现的权重。

## 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%；投资于文体娱乐主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 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 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 130 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、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。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。

## 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	-	6 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11月9日	-	7.5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	-	8.5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。

#### 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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、《银华文体娱乐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

##### 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。

## **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**

#### **1. 报告期内基金投资策略和运作分析**

2020 年上半年，受到新冠肺炎疫情在全球蔓延的影响，市场出现了大幅的波动，随着国内疫情的好转以及疫情管限制制的退出，经济活动逐渐恢复正常，叠加经济周期自身的修复以及逆周期政策的推动，A 股市场整体出现大幅反弹，尤其以科技信息龙头为代表的创业板表现强于主板。上半年创业板上涨 35.6%，沪深 300 上涨 1.6%。文体娱乐类行业中，传媒行业上涨 12.7%，消费者服务为代表的子行业上涨 26.3%，

#### **2. 报告期内基金的业绩表现**

截至本报告期末银华文体娱乐量化股票发起式 A 基金份额净值为 0.9735 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.76%；截至本报告期末银华文体娱乐量化股票发起式 C 基金份额净值为 0.9781 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.60%；同期业绩比较基准收益率为 15.32%。

### **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，传媒行业在经历了四年的下跌后，从去年下半年开始体现超额收益，尤其在疫情期间，游戏和视频行业为拉动传媒指数涨幅的核心因素，板块的消费属性得到认可，估值区间有明显的提升。娱乐需求线上化的状态仍将持续，为在线游戏和视频产品带来确定性的用户及使用时长增量。伴随 5G 技术，边缘计算等技术进步，以及云游戏快速发展，游戏行业处在爆发的前夜，新技术的不断迭代，进一步催化新商业形态的成熟。中长期看，游戏是一个需求稳定，科技属性较强的消费型行业。在盈利方面，下半年，板块从产品周期和业绩增速层面都将持续上升。中长期娱乐消费需求长期稳定存在，板块增长动力充足。在消费升级的大背景下，行业发展空间广阔，看好投资前景，关注价值与成长兼备，发展空间大且盈利企稳的子板块。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历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期末进行利润分配。

#### **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 2017 年 11 月 9 日至 2020 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文体娱乐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，银华文体娱乐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文体娱乐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文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金 2020 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：银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2020年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,585,047.48	1,886,926.30
结算备付金		58,108.93	51,434.53
存出保证金		5,283.66	3,008.80
交易性金融资产	6.4.7.2	27,073,370.38	15,806,195.09
其中：股票投资		27,073,370.38	15,806,195.09
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	484.67	492.67
应收股利		-	-
应收申购款		980,963.17	180,245.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		30,703,258.29	17,928,302.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		625,689.71	262,459.16
应付管理人报酬		17,947.59	13,044.93
应付托管费		1,794.76	1,304.49
应付销售服务费		2,537.61	1,424.22
应付交易费用	6.4.7.7	31,625.22	33,908.03
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	25,039.08	50,037.93
负债合计		704,633.97	362,178.76
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	30,744,701.63	20,669,381.44
未分配利润	6.4.7.10	-746,077.31	-3,103,257.65
所有者权益合计		29,998,624.32	17,566,123.79

负债和所有者权益总计		30,703,258.29	17,928,302.55
------------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，银华文体娱乐量化股票发起式 A 基金份额净值 0.9735 元，基金份额总额 16,074,594.87 份；银华文体娱乐量化股票发起式 C 基金份额净值 0.9781 元，基金份额总额 14,670,106.76 份。银华文体娱乐量化股票发起式份额总额合计为 30,744,701.63 份。

## 6.2 利润表

会计主体：银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		2,663,812.00	1,113,379.82
1.利息收入		6,440.03	5,352.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,440.03	5,352.45
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）		778,392.31	874,800.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	657,414.82	786,591.14
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	6.4.7.13.5	-	-
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	120,977.49	88,209.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,783,138.53	160,122.77
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	95,841.13	73,103.80
<b>减：二、费用</b>		279,060.01	237,223.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	95,392.97	71,585.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,539.32	7,158.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	12,596.13	8,691.95
4. 交易费用	6.4.7.19	135,694.99	113,151.43
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	25,836.60	36,636.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,384,751.99	876,156.26
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,384,751.99	876,156.26

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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)	20,669,381.44	-3,103,257.65	17,566,123.79
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数 (本期利润)	-	2,384,751.99	2,384,751.99
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)	10,075,320.19	-27,571.65	10,047,748.54
其中：1.基金申购款	39,372,981.11	-3,843,860.35	35,529,120.76
2.基金赎回款	-29,297,660.92	3,816,288.70	-25,481,372.22
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)	30,744,701.63	-746,077.31	29,998,624.32
项目	上年度可比期间 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)	20,794,194.56	-6,824,976.52	13,969,218.04
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数 (本期利润)	-	876,156.26	876,156.26
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)	-2,155,590.86	818,055.96	-1,337,534.90
其中：1.基金申购款	17,866,723.54	-4,065,963.45	13,800,760.09
2.基金赎回款	-20,022,314.40	4,884,019.41	-15,138,294.99
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	18,638,603.70	-5,130,764.30	13,507,839.40

(基金净值)			
--------	--	--	--

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

### 1.

### 基金基本情况

银华文体娱乐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】989号文《关于准予银华文体娱乐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售,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《银华文体娱乐量化优选股票型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10月16日至2017年11月3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13,776,882.99元(其中,A类份额认购有效净认购资金为人民币11,261,059.75元,折算成基金份额计11,261,059.75份;C类份额认购有效净认购资金为人民币2,515,823.24元,折算成基金份额计2,515,823.24份),在募集期间产生的利息为人民币3,403.48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3,190.99元,折算成基金份额计3,190.99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212.49元,折算成基金份额计212.49份),以上实收基金(本息)合计为人民币13,780,286.47元,折合13,780,286.47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11月9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《银华文体娱乐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,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债券、中期票据、可转换公司债券(含分离交易的可转换



公司债券)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、非金融企业债务融资工具、银行存款(包括定期存款和协议存款及其他银行存款)、金融衍生品(股指期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定);股票投资占基金资产的比例为 80%-95%;投资于文体娱乐主题上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准是:中证文体指数收益率 $\times 90\%$ +商业银行人民币活期存款利率(税后) $\times 10\%$ 。

## 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。

## 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 4. 重要会计政策和会计估计

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。

## 5. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6. 会计政策变更的说明

无。

### 7. 会计估计变更的说明

无。

### 8. 差错更正的说明

无。

## 9. 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。

## 10.

### 重要财务报表项目的说明

#### 11. 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	2,585,047.48
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：	2,585,047.48
-----	--------------

## 12. 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	24,050,579.38	27,073,370.38	3,022,791.00
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	24,050,579.38	27,073,370.38	3,022,791.00

## 13. 衍生金融资产/负债

无。

## 14. 买入返售金融资产

无。

## 15. 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	456.17
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	26.20
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	2.30
合计	484.67

**16. 其他资产**

无。

**17. 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	31,625.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	31,625.22

**18. 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	176.06
应付证券出借违约金	-
预提费用	24,863.02
合计	25,039.08

**19. 实收基金**

金额单位：人民币元

银华文体娱乐量化股票发起式 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,514,320.78	14,514,320.78
本期申购	11,340,090.53	11,340,090.53
本期赎回(以“-”号填列)	-9,779,816.44	-9,779,816.44
- 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	16,074,594.87	16,074,594.87

金额单位：人民币元

银华文体娱乐量化股票发起式 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	6,155,060.66	6,155,060.66
本期申购	28,032,890.58	28,032,890.58
本期赎回(以“-”号填列)	-19,517,844.48	-19,517,844.48
- 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	14,670,106.76	14,670,106.76

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。

## 20. 未分配利润

单位：人民币元

银华文体娱乐量化股票发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,480,798.09	1,279,235.38	-2,201,562.71
本期利润	414,722.08	1,302,341.18	1,717,063.26
本期基金份额交易产生的变动数	-378,448.07	437,732.78	59,284.71
其中：基金申购款	-2,538,072.25	1,259,472.61	-1,278,599.64
基金赎回款	2,159,624.18	-821,739.83	1,337,884.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,444,524.08	3,019,309.34	-425,214.74

单位：人民币元

银华文体娱乐量化股票发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,445,657.16	543,962.22	-901,694.94
本期利润	186,891.38	480,797.35	667,688.73
本期基金份额交易产生的变动数	-1,827,670.87	1,740,814.51	-86,856.36
其中：基金申购款	-6,051,698.95	3,486,438.24	-2,565,260.71
基金赎回款	4,224,028.08	-1,745,623.73	2,478,404.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,086,436.65	2,765,574.08	-320,862.57

**21. 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	5,804.01
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	599.34
其他	36.68
合计	6,440.03

**22. 股票投资收益****23. 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	44,423,357.80
减：卖出股票成本总额	43,765,942.98
买卖股票差价收入	657,414.82

**24. 债券投资收益**

无。

**25. 贵金属投资收益**

无。

**26. 衍生工具收益**

注：无。

**27. 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	120,977.49
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	120,977.49

## 28. 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	1,783,138.53
——股票投资	1,783,138.53
——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	1,783,138.53

## 29. 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	94,137.98
转换费收入 005239	973.32
转换费收入 005240	729.83
合计	95,841.13

## 30. 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	135,694.99
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	135,694.99
----	------------

**31. 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	973.58
合计	25,836.60

**32. 或有事项、资产负债表日后事项的说明****33. 或有事项**

无。

**34. 资产负债表日后事项**

无。

**35. 关联方关系****36. 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

无。

**37. 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

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。

**38. 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****39. 通过关联方交易单元进行的交易****40. 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	-	-	1,276,474.24	1.56%

#### 41. 债券交易

无。

#### 42. 债券回购交易

无。

#### 43. 权证交易

无。

#### 44. 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	933.51	1.45%	-	-

#### 45. 关联方报酬

#### 46. 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	95,392.97
其中：支付销售机构的客户维护费	22,476.64	15,309.70

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。

#### 47. 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,539.32	7,158.50

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。

#### 48. 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		
	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		
	银华文体娱乐量化股票发起式 A	银华文体娱乐量化股票发起式 C	合计
中国工商银行	-	1,426.81	1,426.81
银华基金管理股份有限公司	-	125.50	125.50
合计	-	1,552.31	1,552.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	银华文体娱乐量化股票发起式 A	银华文体娱乐量化股票发起式 C	合计
银华基金管理股份有限	-	39.08	39.08

公司			
中国工商银行	-	1,501.02	1,501.02
合计	-	1,540.10	1,540.10

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。

#### 49. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 50. 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

无。

#### 51. 各关联方投资本基金的情况

#### 52. 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	银华文体娱乐量化股票发起式 A	银华文体娱乐量化股票发起 式 C
基金合同生效日（2017 年 11 月 9 日）持有的基金份额	10,003,000.30	-
报告期初持有的基金份额	10,003,000.30	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,003,000.30	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	62.23%	-

项目	上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	银华文体娱乐量化股票发起式 A	银华文体娱乐量化股票发起式 C
基金合同生效日（2017 年 11 月 9 日）持有的基金份额	10,003,000.30	-
报告期初持有的基金份额	10,003,000.30	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,003,000.30	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	73.92%	-

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。

### 53. 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

无。

### 54. 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		上年度可比期间	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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	2,585,047.48	5,804.01	1,369,895.92	4,762.58

### 55. 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

### 56. 其他关联交易事项的说明

无。

**57. 利润分配情况**

无。

**58. 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

无。

**59. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

无。

**60. 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

**61. 金融工具风险及管理****62. 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；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

**63. 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度的证券，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。

**64. 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。

## 65. 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。

## 66. 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。

## 67. 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。

## 68. 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	--------	-------	-------	-----	----

2020年6月30日			年				
资产							
银行存款	2,585,047.48	-	-	-	-	-	2,585,047.48
结算备付金	58,108.93	-	-	-	-	-	58,108.93
存出保证金	5,283.66	-	-	-	-	-	5,283.66
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-27,073,370.38	27,073,370.38
应收利息	-	-	-	-	-	484.67	484.67
应收申购款	1,000.00	-	-	-	-	979,963.17	980,963.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,649,440.07	-	-	-	-	-28,053,818.22	30,703,258.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	625,689.71	625,689.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,947.59	17,947.59
应付托管费	-	-	-	-	-	1,794.76	1,794.76
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,537.61	2,537.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,625.22	31,625.22
其他负债	-	-	-	-	-	25,039.08	25,039.08
负债总计	-	-	-	-	-	704,633.97	704,633.97
利率敏感度缺口	2,649,440.07	-	-	-	-	-27,349,184.25	29,998,624.32
上年度末 2019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	1,886,926.30	-	-	-	-	-	1,886,926.30
结算备付金	51,434.53	-	-	-	-	-	51,434.53
存出保证金	3,008.80	-	-	-	-	-	3,008.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-15,806,195.09	15,806,195.09
应收利息	-	-	-	-	-	492.67	492.67
应收申购款	-	-	-	-	-	180,245.16	180,245.16
资产总计	1,941,369.63	-	-	-	-	-15,986,932.92	17,928,302.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	262,459.16	262,459.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	13,044.93	13,044.93
应付托管费	-	-	-	-	-	1,304.49	1,304.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,424.22	1,424.22
应付交易费用	-	-	-	-	-	33,908.03	33,908.03
其他负债	-	-	-	-	-	50,037.93	50,037.93
负债总计	-	-	-	-	-	362,178.76	362,178.76
利率敏感度缺口	1,941,369.63	-	-	-	-	-15,624,754.16	17,566,123.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

## 69. 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。

## 70. 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。

## 71. 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	27,073,370.38	90.25	15,806,195.09	89.98
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	27,073,370.38	90.25	15,806,195.09	89.98

## 72. 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（2020年6月 30日）	上年度末（2019年12 月31日）
	业绩比较基准上升 5%	763,447.61	609,687.92
	业绩比较基准下降 5%	-763,447.61	-609,687.92

**73. 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	27,073,370.38	88.18
	其中：股票	27,073,370.38	88.18
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	2,643,156.41	8.61
8	其他各项资产	986,731.50	3.21
9	合计	30,703,258.29	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 1.

#### 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,443,581.43	4.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	563,350.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	599,008.39	2.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,361,102.58	47.87
J	金融业	-	-
K	房地产业	103,068.00	0.34
L	租赁和商务服务业	1,848,278.15	6.16

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	241,425.00	0.80
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,913,556.83	26.38
S	综合	-	-
	合计	27,073,370.38	90.25

## 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	002555	三七互娱	44,729	2,093,317.20	6.98
2	603444	吉比特	3,360	1,844,673.60	6.15
3	300770	新媒股份	7,828	1,750,810.48	5.84
4	002624	完美世界	27,456	1,582,563.84	5.28
5	002027	分众传媒	230,731	1,285,171.67	4.28
6	300413	芒果超媒	15,199	990,974.80	3.30
7	300315	掌趣科技	125,537	920,186.21	3.07
8	300251	光线传媒	64,693	705,800.63	2.35
9	300133	华策影视	91,593	664,049.25	2.21
10	601928	凤凰传媒	94,719	644,089.20	2.15
11	600373	中文传媒	49,558	583,793.24	1.95
12	002602	世纪华通	36,004	551,221.24	1.84
13	600386	北巴传媒	150,000	517,500.00	1.73
14	600637	东方明珠	51,849	500,342.85	1.67
15	603000	人民网	25,022	496,186.26	1.65
16	601098	中南传媒	44,500	470,810.00	1.57
17	603258	电魂网络	7,907	439,312.92	1.46
18	601999	出版传媒	61,534	435,660.72	1.45
19	300031	宝通科技	16,839	421,648.56	1.41
20	002131	利欧股份	104,923	405,002.78	1.35
21	300079	数码科技	84,054	399,256.50	1.33
22	600633	浙数文化	39,650	387,777.00	1.29
23	600754	锦江酒店	13,681	379,647.75	1.27

24	603533	掌阅科技	9,700	369,861.00	1.23
25	603888	新华网	16,200	362,232.00	1.21
26	600757	长江传媒	64,464	328,121.76	1.09
27	601949	中国出版	61,681	323,825.25	1.08
28	002117	东港股份	26,388	297,656.64	0.99
29	601900	南方传媒	32,756	296,114.24	0.99
30	600088	中视传媒	19,933	288,829.17	0.96
31	300533	冰川网络	7,336	265,416.48	0.88
32	300494	盛天网络	10,500	250,425.00	0.83
33	002607	中公教育	8,700	241,425.00	0.80
34	300148	天舟文化	58,922	233,331.12	0.78
35	600959	江苏有线	61,207	230,138.32	0.77
36	600977	中国电影	17,382	228,225.66	0.76
37	600258	首旅酒店	14,272	219,360.64	0.73
38	300061	旗天科技	36,300	218,889.00	0.73
39	002238	天威视讯	31,134	211,399.86	0.70
40	601811	新华文轩	20,413	207,600.21	0.69
41	300043	星辉娱乐	50,140	200,560.00	0.67
42	603729	龙韵股份	9,600	197,472.00	0.66
43	300144	宋城演艺	10,075	174,297.50	0.58
44	601929	吉视传媒	81,000	173,340.00	0.58
45	000917	电广传媒	24,800	156,736.00	0.52
46	000156	华数传媒	14,436	156,341.88	0.52
47	601801	皖新传媒	27,037	150,325.72	0.50
48	002701	奥瑞金	35,300	147,907.00	0.49
49	300182	捷成股份	36,900	147,231.00	0.49
50	300146	汤臣倍健	7,141	140,606.29	0.47
51	300038	数知科技	16,800	137,088.00	0.46
52	002292	奥飞娱乐	15,606	131,402.52	0.44
53	002343	慈文传媒	13,900	120,652.00	0.40
54	300291	华录百纳	22,513	119,769.16	0.40
55	600640	号百控股	5,920	118,104.00	0.39
56	002558	巨人网络	6,500	113,100.00	0.38
57	300528	幸福蓝海	16,000	106,240.00	0.35
58	600158	中体产业	12,600	103,068.00	0.34
59	600138	中青旅	10,404	102,687.48	0.34
60	601599	鹿港文化	36,300	102,003.00	0.34
61	002174	游族网络	3,694	96,339.52	0.32
62	002626	金达威	3,682	95,584.72	0.32
63	603096	新经典	1,572	92,795.16	0.31
64	002739	万达电影	5,600	85,512.00	0.29

65	002599	盛通股份	20,454	80,588.76	0.27
66	000719	中原传媒	10,455	72,766.80	0.24
67	000681	视觉中国	3,700	68,894.00	0.23
68	600037	歌华有线	4,395	66,804.00	0.22
69	300295	三六五网	4,900	60,368.00	0.20
70	600715	文投控股	21,400	57,138.00	0.19
71	300467	迅游科技	3,163	55,099.46	0.18
72	600229	城市传媒	6,858	50,886.36	0.17
73	000529	广弘控股	6,600	48,576.00	0.16
74	000829	天音控股	7,000	45,850.00	0.15
75	603613	国联股份	473	44,462.00	0.15
76	002400	省广集团	4,200	44,058.00	0.15
77	600880	博瑞传播	9,300	43,059.00	0.14
78	300788	中信出版	700	33,733.00	0.11
79	300459	金科文化	7,800	26,910.00	0.09
80	300426	唐德影视	2,900	20,445.00	0.07
81	002425	凯撒文化	900	15,804.00	0.05
82	002261	拓维信息	1,700	13,872.00	0.05
83	603103	横店影视	775	12,245.00	0.04

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 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	300770	新媒股份	2,431,811.00	13.84
2	002624	完美世界	1,431,350.00	8.15
3	300315	掌趣科技	1,312,409.00	7.47
4	300133	华策影视	1,172,333.18	6.67
5	002027	分众传媒	1,113,447.00	6.34
6	603444	吉比特	1,032,609.00	5.88
7	002555	三七互娱	1,023,515.00	5.83
8	002174	游族网络	906,722.00	5.16
9	600386	北巴传媒	906,414.00	5.16
10	600373	中文传媒	881,952.00	5.02
11	300079	数码科技	855,908.00	4.87
12	300528	幸福蓝海	851,785.00	4.85
13	601928	凤凰传媒	846,962.00	4.82

14	300413	芒果超媒	837,140.00	4.77
15	000719	中原传媒	789,848.00	4.50
16	600959	江苏有线	787,243.00	4.48
17	300418	昆仑万维	771,328.00	4.39
18	601098	中南传媒	770,116.17	4.38
19	600754	锦江酒店	748,517.00	4.26
20	600633	浙数文化	741,588.00	4.22
21	600640	号百控股	732,378.00	4.17
22	600637	东方明珠	724,010.00	4.12
23	600551	时代出版	695,732.00	3.96
24	300251	光线传媒	690,622.00	3.93
25	603000	人民网	688,918.00	3.92
26	601900	南方传媒	657,849.00	3.74
27	000156	华数传媒	636,084.00	3.62
28	600936	广西广电	619,670.00	3.53
29	002602	世纪华通	612,898.00	3.49
30	603729	龙韵股份	609,971.00	3.47
31	601949	中国出版	594,283.00	3.38
32	300291	华录百纳	576,357.00	3.28
33	300295	三六五网	561,709.00	3.20
34	002238	天威视讯	561,075.00	3.19
35	603103	横店影视	559,232.00	3.18
36	300182	捷成股份	547,243.00	3.12
37	600258	首旅酒店	540,987.00	3.08
38	300242	佳云科技	536,610.00	3.05
39	002739	万达电影	533,478.00	3.04
40	603258	电魂网络	532,687.00	3.03
41	002131	利欧股份	520,027.00	2.96
42	601929	吉视传媒	518,659.00	2.95
43	300061	旗天科技	515,385.00	2.93
44	601811	新华文轩	502,361.00	2.86
45	002832	比音勒芬	483,950.00	2.76
46	601599	鹿港文化	468,494.00	2.67
47	601999	出版传媒	464,957.00	2.65
48	600757	长江传媒	464,420.00	2.64
49	600088	中视传媒	464,288.00	2.64
50	600977	中国电影	459,005.00	2.61
51	300043	星辉娱乐	448,038.00	2.55

52	000829	天音控股	442,001.00	2.52
53	300459	金科文化	436,527.00	2.49
54	600986	科达股份	435,582.00	2.48
55	002701	奥瑞金	411,313.00	2.34
56	002117	东港股份	407,270.00	2.32
57	300031	宝通科技	396,293.00	2.26
58	300148	天舟文化	393,845.00	2.24
59	603888	新华网	373,189.00	2.12
60	603533	掌阅科技	369,044.00	2.10
61	300144	宋城演艺	368,787.00	2.10
62	300494	盛天网络	366,696.00	2.09
63	601801	皖新传媒	363,904.00	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。

## 2. 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300770	新媒股份	1,151,882.85	6.56
2	300413	芒果超媒	1,031,991.25	5.87
3	300059	东方财富	962,203.28	5.48
4	002027	分众传媒	860,871.14	4.90
5	600637	东方明珠	843,639.29	4.80
6	300315	掌趣科技	840,948.94	4.79
7	000719	中原传媒	833,809.98	4.75
8	600959	江苏有线	820,161.94	4.67
9	300418	昆仑万维	799,427.98	4.55
10	300528	幸福蓝海	795,267.95	4.53
11	002555	三七互娱	764,644.58	4.35
12	600551	时代出版	754,682.98	4.30
13	603103	横店影视	718,638.69	4.09
14	600936	广西广电	711,305.95	4.05
15	002174	游族网络	699,512.48	3.98
16	300242	佳云科技	689,547.72	3.93
17	600386	北巴传媒	682,119.91	3.88
18	600633	浙数文化	666,175.75	3.79
19	300182	捷成股份	657,855.49	3.75
20	601928	凤凰传媒	641,514.18	3.65
21	601811	新华文轩	625,592.83	3.56

22	002238	天威视讯	607,625.74	3.46
23	601929	吉视传媒	598,607.46	3.41
24	603729	龙韵股份	585,134.89	3.33
25	600640	号百控股	565,044.75	3.22
26	002095	生意宝	552,903.74	3.15
27	600977	中国电影	550,519.87	3.13
28	002400	省广集团	548,851.33	3.12
29	601801	皖新传媒	548,831.33	3.12
30	600754	锦江酒店	518,775.53	2.95
31	300295	三六五网	517,721.04	2.95
32	300291	华录百纳	506,522.32	2.88
33	002832	比音勒芬	496,769.62	2.83
34	300251	光线传媒	481,358.40	2.74
35	600258	首旅酒店	480,841.37	2.74
36	603258	电魂网络	475,248.85	2.71
37	300226	上海钢联	465,929.54	2.65
38	002123	梦网集团	461,154.17	2.63
39	000156	华数传媒	459,551.89	2.62
40	600037	歌华有线	456,035.60	2.60
41	300133	华策影视	452,030.76	2.57
42	300079	数码科技	446,240.04	2.54
43	600373	中文传媒	435,990.19	2.48
44	002739	万达电影	422,217.62	2.40
45	000829	天音控股	421,011.51	2.40
46	601098	中南传媒	410,111.18	2.33
47	601949	中国出版	406,683.54	2.32
48	300144	宋城演艺	402,676.43	2.29
49	601599	鹿港文化	395,162.03	2.25
50	600986	科达股份	389,711.78	2.22
51	601900	南方传媒	380,306.46	2.16
52	002621	美吉姆	371,705.04	2.12

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。

### 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	53,249,979.74
卖出股票收入（成交）总额	44,423,357.80

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**

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**

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**

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**

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**

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**

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**

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****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。

**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。

**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	5,283.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	484.67
5	应收申购款	980,963.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	986,731.50
---	----	------------

#### **4. 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### **5. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

#### **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
银华文体娱乐量化股票发起式A	1,634	9,837.57	10,003,000.30	62.23%	6,071,594.57	37.77%
银华文体娱乐量化股票发起式C	4,811	3,049.28	0.00	0.00%	14,670,106.76	100.00%
合计	6,445	4,770.32	10,003,000.30	32.54%	20,741,701.33	67.46%

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	银华文体娱乐量化股票发起式A	8,544.05	0.05%
	银华文体娱乐量化股票发起式C	10.00	0.00%
	合计	8,554.05	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

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	10,003,000.30	32.54	10,003,000.30	32.54	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,003,000.30	32.54	10,003,000.30	32.54	3年

注：截至本报告期末，基金管理人持有本基金份额 10,003,000.30 份，其中认购份额 10,000,000.00 份，认购期间利息折算份额 3,000.30 份。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	银华文体娱乐量 化股票发起式 A	银华文体娱乐量 化股票发起式 C
基金合同生效日（2017 年 11 月 9 日）基金份 额总额	11,264,250.74	2,516,035.73
本报告期期初基金份额总额	14,514,320.78	6,155,060.66
本报告期基金总申购份额	11,340,090.53	28,032,890.58
减：本报告期基金总赎回份额	9,779,816.44	19,517,844.48
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	16,074,594.87	14,670,106.76

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，本基金托管人的专门基金托管部门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

报告期内本基金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

#### 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	
东方财富证券股份有限公司	4	21,561,673.32	22.08%	20,080.44	24.31%	新增2个交易单元
瑞银证券有限责任公司	1	14,557,335.56	14.90%	13,557.21	16.41%	-
东吴证券股份有限公司	2	12,110,204.36	12.40%	8,856.20	10.72%	-
国盛证券股	2	10,830,497.57	11.09%	7,919.82	9.59%	-

份有限公司						
中泰证券股份有限公司	4	10,177,964.91	10.42%	9,478.56	11.47%	新增 1 个交易单元
野村东方国际证券有限公司	2	9,342,110.97	9.56%	6,831.97	8.27%	新增 2 个交易单元
浙商证券股份有限公司	2	7,448,286.48	7.63%	5,446.86	6.59%	-
招商证券股份有限公司	1	5,284,652.59	5.41%	4,921.70	5.96%	-
国联证券股份有限公司	1	4,318,807.19	4.42%	4,022.01	4.87%	-
中航证券有限公司	2	2,041,804.59	2.09%	1,493.18	1.81%	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	新增 1 个交易单元
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	0	-	-	-	-	撤销 2 个交易单元
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易日

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。经公司批准后被选择的证券经营机构签订协议。

## 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
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-



国盛证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国 际证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股 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	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期末未通过交易单元进行其他证券投资。

## 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旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告》	四大证券报	2020 年 1 月 18 日
2	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 1 月 18 日
3	《银华基金管理股份有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 24 日
4	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 25 日
5	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同（2020 年 3 月修订）》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 25 日
6	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020 年 3 月 25 日

	号)》		
7	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要(2020年第1号)》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月25日
8	《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下13只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月25日
9	《银华基金管理股份有限公司关于增加中国人寿保险股份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》	四大证券报、中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年3月28日
10	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2019年年度报告提示性公告》	四大证券报	2020年4月18日
11	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金2019年年度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年4月18日
12	《银华基金管理股份有限公司旗下部分基金2020年第1季度报告提示性公告》	四大证券报	2020年4月22日
13	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金2020年第1季度报告》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年4月22日
14	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要(2020年第2号)》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年6月19日
15	《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金更新招募说明书(2020年第2号)》	中国证监会基金电子披露网站及本基金管理人网站	2020年6月19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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/01/01-2020/06/30	10,003,000.30	0.00	0.00	10,003,000.30	32.54%

#### 产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2020 年 3 月 25 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金信息披露管理办法〉修改旗下 13 只公募基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告》，对本基金基金合同、托管协议、招募说明书及摘要信息披露有关条款进行了修改。相关法律文件的修改自本公告发布之日起生效。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 银华文体娱乐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 《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》

12.1.4 《银华文体娱乐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](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2020年8月28日