银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:银华基金管理股份有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2018年8月28日

§1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年2月11日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	银华岁丰定期开放债券发起式
基金主代码	005286
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月11日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,009,999,400.04份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握债券市场的收益率变化,在控制风险的前提下力争为投资人获取稳健回报。
投资策略	封闭期内,本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,动态调整组合久期和债券的结构,并通过自下而上精选债券,获取优化收益。开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。 本基金投资组合比例为:债券投资占基金资产的比例不低于80%,但在每次开放期开始前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;在开放期内,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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。
业绩比较基准	中债综合指数(全价)。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险、预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	曾麓燕
	联系电话	(010)58163000	021-52629999-212040
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	015292@cib.com.cn
客户服务电话		4006783333,(010)85186558	95561
传真		(010)58163027	021-62535823

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年2月11日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	14,061,084.03
本期利润	18,922,203.02
加权平均基金份额本期利润	0.0187
本期加权平均净值利润率	1.86%
本期基金份额净值增长率	1.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	14,061,084.03
期末可供分配基金份额利润	0.0139
期末基金资产净值	1,028,921,603.06
期末基金份额净值	1.0187
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.87%

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中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告中所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,例如:基金的认购、申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金于2018年2月11日成立,截止到本报告期末未满半年,主要财务指标的实际计算期间为2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日。

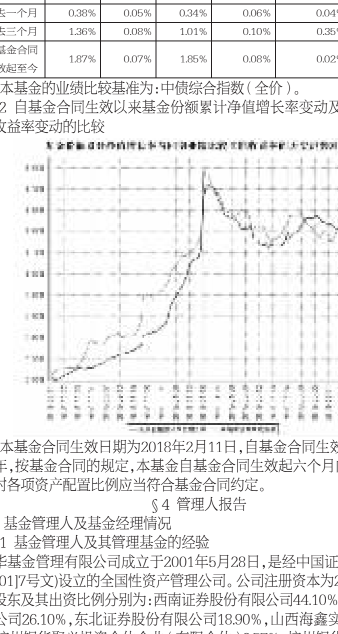
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.38%	0.05%	0.34%	0.06%	0.04%	-0.01%
过去三个月	1.36%	0.08%	1.01%	0.10%	0.35%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.87%	0.07%	1.85%	0.08%	0.02%	-0.01%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合指数(全价)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金合同生效日期为2018年2月11日,自基金合同生效日起到报告期末不满一年,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日,是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为2.222亿元人民币,公司的股东及其出资比例分别为:西南证券股份有限公司44.10%,第一创业证券股份有限公司26.10%,东北证券股份有限公司18.90%,山西海鑫实业股份有限公司0.90%,杭州银华聚义投资合伙企业(有限合伙)3.57%,杭州银华致信投资合伙企业(有限合伙)3.20%,杭州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2018年6月30日,本基金管理人管理着100只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深300指数分级证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金(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指数分级证券投资基金、银华永祥灵活配置混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利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、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华双动力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、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证5年期国债指数证券投资基金、银华上证10年期国债指数证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华惠安定期开放混合型证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证5年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证10年期地方政府债指数证券投资基金、银华中债AAA信用债指数证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟内在价值灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华中证全指医药卫生指数增强型发起式证券投资基金、银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金、银华医疗健康量化优选股票型发起式证券投资基金、银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金、银华估值优势混合型证券投资基金、银华多元动力灵活配置混合型证券投资基金、银华稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华多元收益定期开放混合型证券投资基金、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积极成长混合型证券投资基金、银华瑞和灵活配置混合型证券投资基金、银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金、银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华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。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		
吴文明先生	本基金的基金经理	2018年2月11日	-	8.5年	硕士学位。曾任职于威海市商业银行股份有限公司,2014年加盟银华基金管理有限公司,曾担任银华基金管理有限公司投资管理三部基金经理助理。自2017年3月15日起担任银华永利债券型证券投资基金基金经理,自2017年4月26日起兼任银华惠安定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2017年5月12日起兼任银华惠丰定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2018年5月25日起兼任银华茂定期开放债券型证券投资基金基金经理,自2018年6月27日起兼任银华信用债券型证券投资基金(LOF)、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金及银华通利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。
赵旭东先生	本基金的基金经理助理	2018年3月15日	-	6.5年	硕士学位,曾就职于中债资信评估有限责任公司,2015年5月加入银华基金,历任投资管理三部信用研究员,现任投资管理三部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。
边慧女士	本基金的基金经理助理	2018年3月15日	-	6.5年	硕士学位,曾就职于中国中投证券有限责任公司,2016年12月加入银华基金,现任投资管理三部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。
赵楠楠女士	本基金的基金经理助理	2018年3月15日	-	7.5年	硕士学位,曾就职于世德贝投资咨询(北京)有限公司、大公国际资信评估有限公司、中融基金管理有限公司,2017年1月加入银华基金,现任投资管理三部基金经理助理。具有从业资格。国籍:中国。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效之日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华岁丰定期开放债券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不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,经济运行较为平稳,部分经济数据有走弱迹象。二季度实际GDP增速下行0.1个百分点至6.7%,4-6月工业增加值当月同比连续回落,经济动能有所减弱。1-6月固定资产投资累计同比6.0%,大幅回落,主要受基建拖累,6月房地产投资下行有所加快,后续仍需重点观察地产销售表现。通胀方面,上半年只有2月CPI数据稍高,同比上涨2.9%,全国大范围降温天气,加之春节期间需求和消费量增加,整体推高了食品价格,其余月份CPI维持低位。PPI呈现先回落后回升态势,4-6月PPI连续回升,石油化工及上游工业品贡献较大。市场流动性方面,银行间资金市场总体保持平稳,较2017年下半年边际有所宽松。上半年尤其二季度,受融资条件收紧等影响,信用风险爆发较多,同时中美贸易摩擦不断,给经济运行及股债投资均带来一定影响。

债市方面,上半年债券市场呈波动上涨局面。10年期利率债收益率下行50-70bp,3年高等级信用债收益率下行75bp左右。受信用风险爆发、以及资管新规等影响,信用债表现有所分化,中低评级信用债表现不及高等级信用债。

上半年,本基金保持适度杠杆和久期,择机配置中高等级债券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0187元,本报告期份额净值增长率为1.87%,同期业绩比较基准收益率为1.85%。

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2018年下半年,国际方面,中美贸易摩擦不断,预计未来仍将反复,出口将成为影响国内经济的重要变量。国内方面,经济韧性暂时仍在,但在随着融资收紧、打破刚性兑付条件下,信用风险爆发概率加大,经济面临下行风险。通胀方面,需关注油价等对CPI、PPI的影响。流动性方面,预计央行将保持资金面平稳充裕。监管方面,在化解金融风险、去杠杆的大背景下,理财等新规细则或将相继出台,对债市产生进一步影响。

基于以上分析,本基金将维持适度杠杆与久期,在严格控制信用风险的前提下,对组合配置进行优化调整。

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

本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内,本基金存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形,出现该情况的时间范围为2018年2月11日至2018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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日
资 产:	
银行存款	1,014,027.51
结算备付金	35,959,150.42
存出保证金	117,353.89
交易性金融资产	1,197,193,040.00
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	1,197,193,040.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	20,700,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	22,740,626.49
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,277,724,198.31
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	248,300,000.00
应付证券清算款	56,174.07
应付赎回款	-
应付管理人报酬	252,856.71
应付托管费	84,285.56
应付销售服务费	-
应付交易费用	6,682.45
应交税费	110,716.50
应付利息	-77,254.84
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	69,134.80
负债合计	248,802,595.25
所有者权益:	
实收基金	1,009,999,400.04
未分配利润	18,922,203.02
所有者权益合计	1,028,921,603.06
负债和所有者权益总计	1,277,724,198.31

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0187元,基金份额总额1,009,999,400.04份。

6.2 利润表

会计主体:银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期:2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	24,437,725.16
1.利息收入	17,711,270.14
其中:存款利息收入	3,790,082.65
债券利息收入	12,405,481.42
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,515,706.07
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,865,336.03
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	1,865,336.03
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	4,861,118.99
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	5,515,522.14
1. 管理人报酬	1,164,992.88
2. 托管费	388,330.93
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	7,030.22
5. 利息支出	3,838,710.91
其中:卖出回购金融资产支出	3,838,710.91
6. 税金及附加	42,502.40
7. 其他费用	73,954.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	18,922,203.02
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	18,922,203.02

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期:2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018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)	1,009,999,400.04	-	1,009,999,400.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,922,203.02	18,922,203.02
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,009,999,400.04	18,922,203.02	1,028,921,603.06

注:1.本期财务报表的实际编制期间系2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日止。

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

银华岁丰定期开放债券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]1861号文《关于准予银华岁丰定期开放债券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《银华岁丰定期开放债券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11月9日至2018年2月7日向社会公开募集。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1,009,999,000.00元,在募集期间产生的利息为人民币400.04元,以上实收基金(本息)合计为人民币1,009,999,400.04元,折合1,009,999,400.04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2018年2月11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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及《银华岁丰定期开放债券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发行的金融工具,包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单等以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定);本基金不直接从市场买入股票和权证;本基金的投资组合比例为:债券投资占基金资产的比例不低于80%,但在每次开放期开始前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;在开放期内,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。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。本基金的业绩比较基准是:中债综合指数(全价)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等;

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值;

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2) 不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4) 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金在符合基金法定分红条件的前提下可进行收益分配,具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若基金份额持有人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;红利再投资方式免收再投资的费用;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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债券免征营业税和增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税;

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税;

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

6.4.7 关联方关系

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

无。

6.4.7.2 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
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人

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。

6.4.8 本报告期的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,164,992.88
其中:支付销售机构的客户维护费	-

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.30%/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,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	388,330.93

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.1%/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,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日
基金合同生效日(2018年2月11日)持有的基金份额	10,000,400.04
期初持有的基金份额	10,000,400.04
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减:期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,000,400.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.99%

注: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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业银行股份有限公司北京分行	999,999,000.00	99.01%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年2月11日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,014,027.51	244,563.38

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年06月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币248,300,000.00元,于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,197,193,040.00	93.70
	其中:债券	1,197,193,040.00	93.70
	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	20,700,000.00	1.62
	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	36,973,177.93	2.89
8	其他各项资产	22,857,980.38	1.79
9	合计	1,277,724,198.31	100.00

注:由于四舍五入的原因,市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期内未进行股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,905,000.00	4.95
	其中:政策性金融债	30,753,000.00	2.99
4	企业债券	773,757,040.00	75.20
5	企业短期融资券	120,457,000.00	11.71
6	中期票据	252,074,000.00	24.50
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,197,193,040.00	116.35

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	136837	16穗发01	900,000	88,155,000.00	8.57
2	136513	16电投03	600,000	60,000,000.00	5.83
3	136529	16中车G3	600,000	59,016,000.00	5.74
4	136588	16水务02	600,000	57,666,000.00	5.60
5	101800329	18首农MTN001	500,000	50,410,000.00	4.90

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。

7.11 投资组合报告附注

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

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	117,353.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,740,626.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,857,980.38

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,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

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
2	504,999,700.02	1,009,999,400.04	100.00%	0.00	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:截至本报告期末,本基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,400.04	0.99	10,000,400.04	0.99	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	10,000,400.04	0.99	10,000,400.04	0.99	3年

注:截至本报告期末,基金管理人持有本基金份额10,000,400.04份,其中认购份额10,000,000.00份,认购期间利息折算份额400.04份。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2018年2月11日)基金份额总额	1,009,999,400.04
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,009,999,400.04

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于2018年6月23日发布关于副总经理任职的公告,经本基金管理人董事会审议通过,苏薪茗先生自2018年6月21日起担任本基金管理人副总经理职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务,本报告期内未变更为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
万联证券	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。

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。

3、本基金合同生效日为2018年2月11日,以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

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
万联证券	1,086,791,876.33	100.00%	23,679,300,000.00	100.00%	-	-

注:本基金本报告期末通过交易单元进行股票交易及权证交易。

§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	2018/02/11-2018/06/30	999,999,000.00	0.00	0.00	999,999,000.00	99.01%

产品特有风险

投资人在投资本基金时,将面临本基金的特有风险,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

无。

银华基金管理股份有限公司

2018年8月28日