银华优势企业证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：银华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银华优势企业混合
交易代码	180001
前端交易代码	180001
后端交易代码	180011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月13日
报告期末基金份额总额	691,233,743.32份
投资目标	本基金为平衡型基金，主要通过投资于中国加入WTO后具有竞争优势的上市公司所发行的股票与国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值和稳定红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	坚持平衡原则：平衡收益与风险；平衡长期收益与短期收益；平衡股票与债券的投资；平衡成长型与价值型股票的投资。本基金股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产比例不低于基金总资产的80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%。基于大盘走势关系基金投资全局，本基金充分重视对各市场趋势尤其是对股市大盘趋势的研判，并因此将控制基金仓位放在资产配置和投资组合中的优先位置。本基金资产配置采取自上而下的操作流程，而股票选择采取自下而上的操作流程。
业绩比较基准	标普中国A股300指数×70%+上证国债指数收益率×20%+同业活期存款利率×10%。
风险收益特征	注重收益与风险的平衡，通过控制股票、债券的投资比重来获取中低风险下的中等收益。
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日 - 2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-18,377,470.30
2.本期利润	-83,991,076.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1210
4.期末基金资产净值	711,496,139.23
5.期末基金份额净值	1.0293

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。

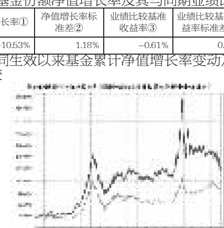
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.53%	1.18%	-0.61%	0.95%	-9.92%	0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：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，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金股票投资比例浮动范围：20-70%；债券投资比例浮动范围：20-70%；现金留存比例浮动范围：5-15%；投资证券的资产比例不低于基金总资产的80%；投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鑫钢先生	本基金的基金经理	2013年2月7日	-	9年	硕士学位。2008年3月加盟银华基金管理有限公司，曾担任行业研究员、行业研究组长及基金经理助理职务。自2015年5月6日起兼任银华成长先锋混合型证券投资基金基金经理，自2016年8月1日起兼任银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年10月14日起兼任银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2017年3月17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2日起兼任银华万物互联灵活配置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。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《银华优势企业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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内宏观经济总体运行依然平稳，继续体现出较强的韧性，其中制造业投资和房地产投资数据强劲，出口由于关税落地前的抢跑效应也有较强表现。CPI保持在2.3%左右，通胀温和可控。报告期内，主导市场走势的核心因素仍然在于外围环境与宏观政策，中美贸易摩擦不断升级，并且还有进一步恶化的迹象，极大打击了市场的风险偏好以及对经济前景的预期。在严峻的外围环境下，国内宏观政策开始趋向缓和，一方面去杠杆节奏有所放缓，并通过降准、支持小微企业融资等多项措施来改善紧信用环境，另一方面财政政策更加积极，配套出台多项基建投资与减税等刺激政策。在此背景下，市场开始逐步企稳但结构上出现较大分化，三季度上证综指下跌0.92%，而受风险偏好影响更大的创业板指下跌12.16%。

本基金坚持自下而上的深度研究，优选行业景气度持续向上、业绩确定、估值相对合理的优质成长型龙头公司为核心配置，主要在新能源汽车、自主可控、先进制造等方向，但这类股票受市场风险偏好影响较大，三季度表现一般。

我们认为宏观经济层面的重点不在于总量，而在于结构变化。习近平主席在十九大提出"新时代中国特色社会主义"和"人民日益增长的美好生活需要和不平衡不充分发展之间的矛盾" 表明政策主线已转向鼓励产业升级和高质量发展，对金融杠杆依赖度较高的投资增速大概率会放缓。此外，我们对于流动性的看法相对中性，通胀整体温和可控，不会导致政策取向进一步收紧。总体来看，我们预期2018年的A股市场主要仍以存量资金为主，大概率依然是结构性的市场机会，消费、新能源和互联网等成长行业受益于经济结构调整孕育着丰富的投资机会。但是，中美贸易摩擦有持续升级的态势，给全球经济和资本市场带来巨大不确定性，其进展与影响须持续跟踪与评估。

经过年初至今的大幅调整，市场对于金融去杠杆、中美贸易摩擦等方面的风险担忧已经得到相对充分的释放，并且国内货币和财政政策已经趋向宽松，中美贸易摩擦是个会持续反反复复的长期问题，不应将长期问题过于短期化。另外，对于市场所担忧的中国改革前景，本基金认为改革路上虽有曲折，但仍在一步步落地，本基金对改革的前景充满信心。在此背景下，本基金对四季度的市场表现持相对乐观积极的态度，本基金将保持中性偏高的仓位，在维持当前核心配置的基础上，继续通过自下而上的基本面研究优选具有优秀管理团队、业绩确定并且估值相对合理的新兴成长龙头公司，主要聚焦在信息安全、新能源汽车、半导体、先进制造等领域。同时，密切跟踪金融去杠杆、中美贸易摩擦、证券市场新政策的进展。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0293元；本报告期基金份额净值增长率为-10.53%，业绩比较基准收益率为-0.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	486,172,567.19	67.95
	其中：股票	486,172,567.19	67.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	171,415,017.50	23.96
	其中：债券	171,415,017.50	23.96
	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	55,049,662.37	7.69
8	其他资产	2,882,669.56	0.40
9	合计	715,519,916.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	10,190.00	0.00
B	采矿业	24,827,168.00	3.49
C	制造业	270,241,641.00	37.98
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	12,979,732.14	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	63,582,603.01	8.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,003,986.12	10.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	606,342.19	0.09
R	文化、体育和娱乐业	37,920,904.73	5.33
S	综合	-	-
	合计	486,172,567.19	68.33

5.2.2 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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	567,895	50,389,323.35	7.08
2	603799	华友钴业	916,769	48,854,620.01	6.87
3	600136	当代明诚	2,964,887	37,920,904.73	5.33
4	000022	深赤湾A	1,536,098	29,692,774.34	4.17
5	002371	北方华创	624,285	29,378,852.10	4.13
6	000066	中国长城	4,036,419	26,519,272.83	3.73
7	600711	盛屯矿业	3,608,600	24,827,168.00	3.49
8	300339	润和软件	1,978,800	20,480,580.00	2.88
9	300750	宁德时代	215,900	15,760,700.00	2.22
10	002268	卫士通	673,900	15,277,313.00	2.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	171,415,017.50	24.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	171,415,017.50	24.09

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180003	18附息国债03	500,000	50,150,000.00	7.05
2	180010	18附息国债10	500,000	50,050,000.00	7.03
3	010107	21国债(7)	350,230	35,905,579.60	5.05
4	010303	03国债(3)	355,190	35,309,437.90	4.96

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	321,490.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,502,913.54
5	应收申购款	58,265.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,882,669.56

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000022	深赤湾A	29,692,774.34	4.17	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	696,209,430.85
报告期期间基金总申购份额	4,769,201.44
减：报告期期间基金总赎回份额	9,744,888.97
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	691,233,743.32

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准银华优势企业证券投资基金募集的文件

9.1.2《银华优势企业证券投资基金基金合同》

9.1.3《银华优势企业证券投资基金招募说明书》

9.1.4《银华优势企业证券投资基金托管协议》

9.1.5《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 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住所。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。

9.3 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
2018年10月24日

银华优质增长混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：银华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银华优质增长混合
交易代码	180010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月9日
报告期末基金份额总额	1,734,448,994.63份
投资目标	通过投资于兼具优质增长性和估值吸引力的股票，在严格控制投资组合风险的前提下力求取得基金资产的长期快速增值。
投资策略	本基金为混合型基金，在一般情况下，股票投资在基金资产中将保持相对较高的比例。在投资中，本基金首先选取质地良好、估值合理的公司，并从中精选具备优质增长特征或处于优质增长阶段的公司进行投资；在债券投资中，重点关注到期收益率、流动性较高以及价值被低估的债券。本基金的投资比例浮动范围：股票资产为60%-95%；除股票资产以外的其他资产为5%-40%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于5%。本基金的非现金基金资产中，不低于80%的资产将投资于具有优质增长特征或处于优质增长阶段的公司。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的基金产品。
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日 - 2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-296,131,014.44
2.本期利润	-272,439,223.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1568
4.期末基金资产净值	2,207,705,481.54
5.期末基金份额净值	1.2729

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、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、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 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.97%	1.34%	-1.35%	1.08%	-9.62%	0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：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，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金股票投资比例浮动范围：60%-95%；除股票资产以外的其他资产投资比例浮动范围为5%-40%，其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于5%。本基金的非现金基金资产中，不低于80%的资产将投资于具有优质增长特征或处于优质增长阶段的公司。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贲兴振先生	本基金的基金经理	2016年11月2日	-	10年	硕士学位。历任北京城市系统工程研究中心研究员，新华基金管理股份有限公司行业分析师、策略师、基金经理、基金管理部副总监。2016年7月加盟银华基金管理股份有限公司。2018年5月22日起担任银华混改红利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《银华优质增长混合型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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

第三季度，股票市场在经历7月份短暂的反弹后继续调整，一方面因为中美贸易摩擦再次升级，另一方面7月后宏观经济数据相对较差。预计企业微观盈利数据在三季度仍然会有一定的压力。市场调整的幅度也超出了自己的判断，不断学习来加深对市场的理解，提高前瞻性预测能力。

展望第四季度，近期稳增长政策不断推进，发改委推进稳定有效投资，国务院发布关于激发居民消费潜力的相关文件，宏观经济下滑和企业盈利恶化幅度可控。未来市场震荡筑底仍然需要时间，但下调幅度不大。除了短期稳增长的政策，增强中长期经济增长动力和提振市场信心的一系列改革措施也在不断出台，人民币汇率维持在稳健基础上的幅度内波动。重拾市场信心的措施正在累积逐渐发生效用。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.2729元；本报告期基金份额净值增长率为-10.97%，业绩比较基准收益率为-1.35%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,546,755,357.66	69.27
	其中：股票	1,546,755,357.66	69.27
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	669,921,671.57	30.00
8	其他资产	16,152,392.68	0.72
9	合计	2,232,829,421.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,098,020,824.00	49.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,464,554.55	1.52
F	批发和零售业	103,829,417.26	4.70
G	交通运输、仓储和邮政业	12,360,578.36	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,014,177.26	1.86
J	金融业	97,183,619.62	4.40
K	房地产业	53,498,848.20	2.42
L	租赁和商务服务业	61,857,323.35	2.80
M	科学研究和技术服务业	18,004,656.67	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	27,521,358.39	1.25
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,546,755,357.66	70.06

5.2.2 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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	1,512,513	71,859,492.63	3.25
2	002027	分众传媒	6,785,597	57,745,430.47	2.62
3	600276	恒瑞医药	830,575	52,741,512.50	2.39
4	002271	东方雨虹	3,270,035	47,513,608.55	2.15
5	002304	洋河股份	364,156	46,611,968.00	2.11
6	300003	乐普医疗	1,436,300	43,591,705.00	1.97
7	002415	海康威视	1,419,580	40,798,729.20	1.85
8	300059	东方财富	3,243,569	36,490,151.25	1.65
9	000963	华东医药	824,941	34,631,023.18	1.57
10	603589	口子窖	658,875	33,932,062.50	1.54

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,334,475.50
2	应收证券清算款	14,636,548.98
3	应收股利	-
4	应收利息	82,937.19
5	应收申购款	98,431.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,152,392.68

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,741,860,781.49
报告期期间基金总申购份额	14,372,077.36
减：报告期期间基金总赎回份额	21,783,864.22
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,734,448,994.63

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1中国证监会核准银华优质增长股票型证券投资基金募集的文件

9.1.2《银华优质增长混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《银华优质增长混合型证券投资基金招募说明书》

9.1.4《银华优质增长混合型证券投资基金托管协议》

9.1.5《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 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住所。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。

9.3 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
2018年10月24日

银华中证转债指数增强分级证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：银华基金管理股份有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银华中证转债指数增强分级		
场内简称	中证转债		
交易代码	161826		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年8月15日		
报告期末基金份额总额	59,451,192.27份		
投资目标	本基金为增强型可转债指数基金，指数投资部分采用被动指数化投资策略，指数增强部分采取积极配置策略，利用可转债兼具债券和股票的特性，争取为投资者获得超越业绩比较基准的稳健收益。		
投资策略	正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.5%以内，年跟踪误差控制在5%以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金投资策略包括指数投资策略和指数增强策略。本基金的投资组合比例为：投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%，其中投资于中证转债指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金非现金资产的80%；本基金持有现金或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	95%×中证可转换债券指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。		
基金管理人	银华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	转债A级	转债B级	中证转债
下属分级基金的交易代码	150143	150144	161826
报告期末下属分级基金的份额总额	23,251,517.00份	9,964,935.00份	26,234,740.27份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。	较低风险、较低预期收益。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年7月1日 - 2018年9月30日）
1.本期已实现收益	-1,249,452.12
2.本期利润	1,151,023.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0183
4.期末基金资产净值	57,662,805.85
5.期末基金份额净值	0.970

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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、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 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.21%	0.53%	2.56%	0.45%	-0.35%	0.08%

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：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，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的80%，其中投资于中证转债指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金非现金资产的80%；本基金持有现金或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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙慧女士	本基金的基金经理	2016年2月6日	-	7.5年	硕士学位。2010年6月至2012年6月任职中邮人寿保险股份有限公司投资管理部，任投资经理助理；2012年7月至2015年2月任职于华夏人寿保险股份有限公司资产管理中心，任投资经理；2015年3月加盟银华基金管理有限公司，历任基金经理助理；自2016年2月6日至2017年8月7日担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理；自2016年2月6日起兼任银华保本增值证券投资基金基金经理；自2016年10月17日至2018年2月5日兼任银华稳利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自2016年10月17日至2018年6月26日兼任银华永泰积极债券型证券投资基金基金经理；自2016年12月22日起兼任银华远景债券型证券投资基金基金经理；自2017年8月8日起兼任银华永祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自2018年3月7日起兼任银华多元收益定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2018年8月31日起兼任银华可转债债券型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《银华中证转债指数增强分级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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年3季度，全球市场受贸易摩擦持续演进、主要国家货币政策分化加剧、新兴市场资本外流压力上升等因素的影响，各类资产缺乏趋势性表现。国内方面，在信用持续收缩的背景下，经济边际下行压力显现，同时对中美关系前景的担忧进一步抑制风险偏好，资产价格快速回调。但7月底8月初以来，国内政策出现积极变化，有助于缓解信用坍塌的压力，并逐渐传导至经济表现。同时，中美贸易战的悲观预期逐步被price in，股票市场出现从结构性反弹到全面企稳反弹的迹象。债券市场方面，虽然宏观基本面与流动性环境总体趋于利好，但短期内受到积极信用政策、通胀预期升温、地方债集中供给、美联储加息等因素的扰动，收益率暂时中止下行趋势，表现震荡。转债方面，总体表现跟随权益市场，但成交活跃度与估值水平持续走低。此外，受债券市场信用违约事件的冲击，信用资质偏弱的转债个券进一步边缘化，加剧板块内部的结构性分化特征。

3季度，本基金根据对市场的判断进行了一定幅度的波段操作，结构上根据市场特征进行了阶段性的优化，总体与指数保持一致。但规模变动、个券停牌、流动性差异等原因，导致与指数存在一定的偏差。

展望2018年4季度，预计国内中长期经济下行的方向难以迅速扭转、中美摩擦也将持续发生、两国货币政策分化带来的不确定性依然存在。因此，权益市场难有大级别的单边上行机会，仍以结构性机会为主。而在"信用企稳"到"经济企稳"之前的时间差内，无风险利率仍将继续跟随名义经济增速趋于下行，债券市场总体机会大于风险。转债方面，基于权益市场的结构性特征，仍将以深度挖掘个券机会为主，重点关注长期业绩良好、转债及正股估值合理个券，同时兼顾流动性与条款因素。

4季度，本基金将继续跟踪标的指数，通过积极的波段操作和精选品种来增强收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.970元；本报告期基金份额净值增长率为2.21%，业绩比较基准收益率为2.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	62,903,865.22	97.25
	其中：债券	62,903,865.22	97.25
	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	1,493,256.81	2.31
8	其他资产	285,538.68	0.44
9	合计	64,682,660.71	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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。

5.2.2 报告期末积极投资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。

5.2.3 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。

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,127,654.00	5.42
	其中：政策性金融债	3,127,654.00	5.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	59,776,211.22	103.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,903,865.22	109.09

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	112,010	12,137,403.60	21.05
2	128024	宁行转债	36,839	4,183,805.23	7.26
3	113013	国君转债	38,500	4,027,100.00	6.98
4	018005	国开1701	31,090	3,127,654.00	5.42
5	123006	东财转债	25,959	2,992,813.11	5.19

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,783.22
2	应收证券清算款	93,663.69
3	应收股利	-
4	应收利息	185,429.71
5	应收申购款	3,662.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	285,538.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	12,137,403.60	21.05
2	128024	宁行转债	4,183,805.23	7.26
3	113013	国君转债	4,027,100.00	6.98
4	123006	东财转债	2,992,813.11	5.19
5	110032	三一转债	2,692,185.30	4.67
6	113008	电气转债	2,675,682.00	4.64
7	113019	玲珑转债	1,693,230.40	2.94
8	123003	蓝思转债	1,682,840.76	2.92
9	113015	隆基转债	1,480,176.00	2.57
10	110034	九州转债	1,338,199.00	2.32
11	110041	蒙电转债	1,230,247.50	2.13
12	113018	常熟转债	1,123,554.00	1.95
13	110031	航信转债	1,099,610.40	1.91
14	113504	艾华转债	1,049,898.80	1.82
15	127005	长证转债	1,021,030.36	1.77
16	128035	大族转债	1,003,284.00	1.74
17	110042	航电转债	979,672.00	1.70
18	110043	无锡转债	957,352.50	1.66
19	110038	济川转债	926,719.20	1.61
20	113014	林洋转债	870,295.00	1.51
21	113009	广汽转债	820,562.40	1.42
22	128016	雨虹转债	760,210.72	1.32
23	128034	江银转债	665,919.50	1.15
24	110040	生益转债	645,072.00	1.12
25	128010	顺昌转债	578,928.48	1.00
26	127006	敖东转债	576,751.80	1.00
27	128028	赣锋转债	551,023.72	0.96
28	128027	崇达转债	543,645.36	0.94
29	110033	国贸转债	518,470.40	0.90
30	113017	吉视转债	486,199.80	0.84
31	128029	太阳转债	448,421.76	0.78
32	128020	水晶转债	430,513.20	0.75
33	128032	双环转债	335,067.60	0.58
34	128030	天康转债	314,790.00	0.55
35	128022	众信转债	293,870.80	0.51
36	113012	骆驼转债	247,990.60	0.43
37	128015	久其转债	228,924.96	0.40
38	123004	铁汉转债	192,256.74	0.33
39	123009	星源转债	186,597.60	0.32
40	128033	迪龙转债	177,837.00	0.31
41	123007	道氏转债	172,040.00	0.30
42	128017	金禾转债	157,434.42	0.27

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	转债A级	转债B级	中证转债
报告期期初基金份额总额	23,601,671.00	10,115,001.00	25,900,500.14
报告期期间基金总申购份额	-	-	9,264,921.67
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	9,430,901.54
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-350,154.00	-150,066.00	500,220.00
报告期期末基金份额总额	23,251,517.00	9,964,935.00	26,234,740.27

注：如有相应情况，拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算后的调整份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会核准银华中证转债指数增强分级证券投资基金募集的文件

9.1.2《银华中证转债指数增强分级证券投资基金招募说明书》

9.1.3《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》

9.1.4《银华中证转债指数增强分级证券投资基金托管协议》

9.1.5《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 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住所。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。

9.3 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
2018年10月24日