

银华上证10年期国债指数证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24日

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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现。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。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金概况 (Fund Overview) and 主要财务指标 (Key Financial Indicators). Includes details on fund type, strategy, and performance metrics.

3.1 主要财务指标

Table showing financial performance metrics for the fund, including net asset value, returns, and expenses.

3.2 本基金业绩指标

Table comparing the fund's performance against its benchmark (上证10年期国债指数) and a peer group.

3.3 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

3.4 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏



注:按基金合同的规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产比例已达到基金合同约定的规定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table listing the fund manager's name, title, and tenure.

王鹏先生,2011年9月至2017年12月担任银华基金管理股份有限公司基金经理,2018年1月1日起担任银华上证10年期国债指数证券投资基金基金经理。王鹏先生毕业于中央财经大学,拥有硕士学位,具有基金从业资格。

4.2 管理人报告

报告期内,本基金管理人严格遵守《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》及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规的规定,恪尽职守,勤勉尽责,较好地完成了基金合同约定的各项任务。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行《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》及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规的规定,恪尽职守,勤勉尽责,较好地完成了基金合同约定的各项任务。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,经济保持平稳运行,宏观数据有所改善。8月份规模以上工业增加值同比增长6.1%,上下游行业生产活动显现分化,上游行业生产活动较难受到供给侧改革及工业品价格弱复苏的影响。

4.5 投资组合报告

Table showing the fund's portfolio composition, including holdings in government bonds, corporate bonds, and other securities.

4.2 管理人报告

报告期内,本基金管理人严格遵守《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》及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规的规定,恪尽职守,勤勉尽责,较好地完成了基金合同约定的各项任务。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行《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》及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规的规定,恪尽职守,勤勉尽责,较好地完成了基金合同约定的各项任务。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,经济保持平稳运行,宏观数据有所改善。8月份规模以上工业增加值同比增长6.1%,上下游行业生产活动显现分化,上游行业生产活动较难受到供给侧改革及工业品价格弱复苏的影响。

4.5 投资组合报告

Table showing the fund's portfolio composition, including holdings in government bonds, corporate bonds, and other securities.

4.6 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

4.7 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

4.8 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

4.2 管理人报告

报告期内,本基金管理人严格遵守《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》及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规的规定,恪尽职守,勤勉尽责,较好地完成了基金合同约定的各项任务。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行《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》及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》等相关法律法规的规定,恪尽职守,勤勉尽责,较好地完成了基金合同约定的各项任务。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度,经济保持平稳运行,宏观数据有所改善。8月份规模以上工业增加值同比增长6.1%,上下游行业生产活动显现分化,上游行业生产活动较难受到供给侧改革及工业品价格弱复苏的影响。

4.5 投资组合报告

Table showing the fund's portfolio composition, including holdings in government bonds, corporate bonds, and other securities.

4.6 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

4.7 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

4.8 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

5.0 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。
5.10 投资组合报告附注
5.11 投资组合报告附注
5.12 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。

5.13 其他资产构成

Table showing the fund's asset composition, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

5.14 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。

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.16 投资组合报告附注的其他重要事项

由于四舍五入的原因,各项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.7 开放式基金份额变动

Table showing the fund's share performance, including net asset value and returns.

5.8 影响投资者决策的其他重要信息

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.9 备查文件目录

1. 中国证监会核准银华上证10年期国债指数证券投资基金募集申请中国证监会注册的文件

5.10 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

5.11 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

5.12 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

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
报告送出日期:2018年10月24日

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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现。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。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金概况 (Fund Overview) and 主要财务指标 (Key Financial Indicators). Includes details on fund type, strategy, and performance metrics.

3.1 主要财务指标

Table showing financial performance metrics for the fund, including net asset value, returns, and expenses.

3.2 本基金业绩指标

Table comparing the fund's performance against its benchmark (沪深300指数) and a peer group.

3.3 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

3.4 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

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
报告送出日期:2018年10月24日

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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现。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。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金概况 (Fund Overview) and 主要财务指标 (Key Financial Indicators). Includes details on fund type, strategy, and performance metrics.

3.1 主要财务指标

Table showing financial performance metrics for the fund, including net asset value, returns, and expenses.

3.2 本基金业绩指标

Table comparing the fund's performance against its benchmark (沪深300指数) and a peer group.

3.3 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

3.4 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

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
报告送出日期:2018年10月24日

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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现。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。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金概况 (Fund Overview) and 主要财务指标 (Key Financial Indicators). Includes details on fund type, strategy, and performance metrics.

3.1 主要财务指标

Table showing financial performance metrics for the fund, including net asset value, returns, and expenses.

3.2 本基金业绩指标

Table comparing the fund's performance against its benchmark (沪深300指数) and a peer group.

3.3 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

3.4 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

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
报告送出日期:2018年10月24日

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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现。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。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金概况 (Fund Overview) and 主要财务指标 (Key Financial Indicators). Includes details on fund type, strategy, and performance metrics.

3.1 主要财务指标

Table showing financial performance metrics for the fund, including net asset value, returns, and expenses.

3.2 本基金业绩指标

Table comparing the fund's performance against its benchmark (沪深300指数) and a peer group.

3.3 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

3.4 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏

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
报告送出日期:2018年10月24日

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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现。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。

本报告自2018年7月1日起至9月30日止。

Table with 2 columns: 基金概况 (Fund Overview) and 主要财务指标 (Key Financial Indicators). Includes details on fund type, strategy, and performance metrics.

3.1 主要财务指标

Table showing financial performance metrics for the fund, including net asset value, returns, and expenses.

3.2 本基金业绩指标

Table comparing the fund's performance against its benchmark (沪深300指数) and a peer group.

3.3 基金投资组合

Table detailing the fund's asset allocation, including percentages for government bonds, corporate bonds, and other securities.

3.4 基金管理人报告

基金经理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏
基金经理助理:王鹏