中國证券報



银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF) 2018年年度报告摘要

2018年12月31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: 2019年3月28日

送出日期:2019年3月28日 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、 井对其内容的真实性、准确性和完整使承担与别及毒带的法律责任。本年度报告已经三分之二 以上独立董事签字同意,并由董事长签及。 基金托管人中国工能群形形份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3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 客不存在虚假已载、误导性陈述或者国上被遇。 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。

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。 本年度报告接项销自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。 **和中华及公科口经由计

	§ 2 基金简介
1 基金基本情况	
基金名称	银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)
基金简称	银华纯债信用债券(LOF)
场内简称	银华纯债
基金主代码	161820
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8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	1,406,506,097.54%
基金合同存续期	不定期
其今公鄉上市的证券亦具庇	巡押证券亦具底

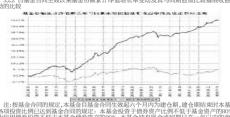
基亚 雷미王双日	2012年8月9日	2012年8月9日			
基金管理人	银华基金管理股份有	限公司			
基金托管人	中国工商银行股份有	中国工商银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	1,406,506,097.54份	1			
基金合同存续期	不定期				
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所				
上市日期	2012年9月5日				
12 基金产品说明	<u> </u>				
投资目标		主要投资对象,在控制信用风险 金持有人提供稳健的当期收益和			
投资策略	对信用債券采取"自 的投资年而上进行个 利率风险和信用风险 的流动性状况,利于 衡 对结价率较高的 本基金的投资至 产比例不低于基金资 低于本基金债券资产	游和企业的财务状况进行分析, 上而下"和"目下而上"相结合 百下确定组合人期非进行废产配 旁的选择。组成对信用偶晶种的 进行度量和现价。同时结合市构 启地进行设置。 自社比例为,本基金投资干值券资 行它的80%,其中目前费券投资不 等的90%,本基金投资干值券资 作的90%,本基金投资干值券资			
业绩比较基准	中债综合指数(全价	中债综合指数(全价)收益率。			
风险收益特征	险品种,其预期风险 低于混合型基金和B	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,其预期风险与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。			
13 基金管理人和基金托管/					
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			

14	F-1-mb4H	ynjjæymu	RECORDER		custoayan	DCCOILCH	
客户服务电话		40067833	40067833333,(010)85186558		95588		
传真		(010)5816	3027		(010)661057	798	
4 信息披露方式	v v						
登载基金年度报告 网址	正文的管	理人互联网	http://w	ww.yhfu	nd.com.cn		
基金年度报告备置	地点		基金管理人及基金托管人住所				
1.1 主要会计数据			甚金净值	表现及和	润分配情を	2	
11 主要云口奴据	刊979日	455				金额单位:人	
3.1.1 期间数据和扩	旨标	2018年		2017	7年	2016年	
本期已实现收益		37,239,	340.28	22,7	10,874.94	144,685,612.1	
本期利润		99,830,	530.95	44,2	29,902.11	36,966,424.2	
加权平均基金份额	i本期利		0.0759		0.0177	0.009	

			金额単位:人
3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	37,239,840.28	22,710,874.94	144,685,612.11
本期利润	99,830,630.95	44,229,902.11	36,966,424.28
加权平均基金份额本期利 润	0.0759	0.0177	0.0096
本期加权平均净值利润率	6.88%	1.64%	0.82%
本期基金份額净值增长率	7.23%	2.34%	1.769
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	4,985,399.28	60,409,711.47	152,917,276.8
期末可供分配基金份额利 润	0.0035	0.0495	0.0359
期末基金资产净值	1,540,616,963.23	1,332,969,029.47	4,552,419,624.29
期末基金份額净值	1.095	1.092	1.06
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	46.34%	35.72%	33.359

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 中购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.1 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 份額净値 増长率①増长率付 准差②機算地域比较基 連収益率标 准差④本3本3本4本3本4 (I) - (3) 同生效以来其余份需要计净值增长率变动及其与同期业绩比较其准的



3.3 过去三年基金的利润分配情况

姓名	职务	任本基金的 理(助理)		证券从	说明	
X±-fs	87795	任职日期	腐任 业年限 日期		100.93	
^{邹维娜女} 士	本基金的理	2014年10月8日	-	11年	部士学位、历任国家信息中心下屬中的 成公司宏观院分析人员,中国资产管 理股份有限公司局定收益解投资经9月 现。自有帐户投资金到。2012年8月7日或 发生助增期分,2013年8月7日或 曾担任基住 级华信用印学红债券证定券投资基金基金空 是2014年8月2日至2018年9月6日末 任银华永澍传券证账券投资基金基金空 现。2014年19月2日至2018年9月6日末 任银华永澍传券证账券投资基金基金空 现。2014年19月2日至2018年9月6日末 任银华永澍分级债券证券投资基金基金空 是2014年19月2日至2018年9月3日末 任银华永澍分级债券证券投资基金基金空 第一2016年3月7日1日起 任银华永澍分级债券证券投资基金基金里,自2016年3月7日日本 抵任银华承澍之期开放债券型证券投资基金 基金基金型,自2016年3月7日日起 任银华海港立即开放债券型证券投资 生基金经则,自2017年3月7日日起 任银华海港市外股债券位 企业是一个企业。1017年3月7日日起 生态量金型,自2017年3月7日日本 生态通验则,自2017年3月7日最新任银 发盈定则,由2017年3月7日日基	
赵旭东先 生	本基金的 基金经理 助理	2016年8月 18日	_	7.5年	硕士学位,曾就职于中债资信评估有际 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	2017年2月 15日	-	7.5年	硕士学位,曾就职于中国中投证券有际 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。	

4.23、企业交易制度的执行情心。
4.23、整体计与情况说明
报告期以,本基金管理人根据《报华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配整制
报告期以,本基金管理人根据《报华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配整制
公平对待据下的每一个投资组合。具体执行情况如下。
在研究分析不节,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 在研究分析环节,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。 研究支持。 在投资决策环节,各基金整理,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投税制度。保证各位资组合的数工投资决策机制。 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、综合学谱"的原则,确保各投资组合享有公平的交易执行制度。 在事后监控环节,本基金管理人定证则对股票交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析程度,分析投资,另外,本基金管理人在小型多别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。 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,未出现违反公平交易制度的信况。 4322同间交易价差专项分析

截至本报货期末本基金的编等值到1.05元;本报告则基金价额净值增长率为7.27%、业绩比较基础收益率为4.7%。
4.5 管理人对宏观经济,证券市场及行业走势的商要规理
原程局市人经济市境中一步放缓,地产和分离对空外的高级保险。由人足过转径旁下污劲势。信用收缩和高水体的明显级等,由于现代通常的小量产品,是一步型现,自前政策托能力度,未被从地方政府债务的实现人是全国运动地产领性。而人民以担转经旁下污劲势。信用较级制而的未来分别可能或是在干着的。我们可以公中核心前心。他上行股票可是,仍对中中核的一个企业。在一个企业,是一个企业的企业。
基本以上的基本面对关闭外,未是一个企业,来看来发现,是一个企业的企业,不是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业,

古值委员会制定的估值政策及决议。 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

室分皆但然格各方之间小存在任何组大利益冲突;基基宣智型人未参约与信值相关的任何服务。 47 管则人对报告制内基金利润分配情况的说明 本基金管理人于2018年06月06日发布公告。向截至2018年06月07日在本基金注册登记机 构登记在册约本基金全体基金份额持有人发放红利,每10份基金份额派发红利0480元。实际分 起金额为人民币 75,889,2474 元。基金管理人于2018年12月0日2日次令公告。向截至2018年 12月06日在本基金注册登记机场登记在册的本基金全体基金份额持有人发放红利,每10份基金 份额派发虹和200元。实际分位金额为人民币 34,194,42420 元。 48,报告期内管理人对本基金特有人或或基金资产净值预整情形的说明 报告期内,未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 净值帐于五十万元的情形。

76。
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实,准确和完整发表意见 木托管人依法的镇华基金管理股份有限公司编制和玻璃的银华规值信用主题值券型证券 投基金(1607)2018年年度报告中财务制造、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,指确和证据。 (6 审计报告 本基金2018年度财务会计报告经卖术即购会计师事务所、特殊普通合伙)审计,注册会计师出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可逾过年度报告正文查看审计报告全文。 71 寄产价格表

7.1 资产负债表 会计主体:银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	973,159.43	991,009.47
结算备付金	36,313,350.71	16,424,878.80
存出保证金	26,741.98	22,228.70
交易性金融资产	1,968,610,261.80	1,341,609,286.90
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,968,610,261.80	1,321,687,286.90
资产支持证券投资	-	19,922,000.00
贵金属投资	-	_
衍生金融资产	-	-
买人返售金融资产	-	-
应收证券清算款	216,498.36	95,875.20
应收利息	38,409,303.14	29,586,378.87
应收股利	-	-
应收申购款	21,016.44	62,474.68
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	
资产总计	2,044,570,331.86	1,388,792,132.59
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31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	501,600,000.00	53,900,000.00
应付证券清算款	-	_
应付赎回款	449,795.38	211,807.34
应付管理人报酬	766,344.12	681,160.67
应付托管费	255,448.03	227,053.58
应付销售服务费	-	_
应付交易费用	3,965.00	3,775.00
应交税费	621,410.80	435,156.28
应付利息	-136,700.32	-26,031.20
应付利润	-	_
递延所得税负债	-	_
其他负债	393,105.62	390,181.49
负债合计	503,953,368.63	55,823,103.12
所有者权益:		
实收基金	1,406,506,097.54	1,220,247,295.8
未分配利润	134,110,865.69	112,721,733.66
所有者权益合计	1,540,616,963.23	1,332,969,029.47
负债和所有者权益总计	2,044,570,331.86	1,388,792,132.59

本报告期: 2018年1月1日至2018年	12月31日	单位:人民
项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
一、收人	122,281,312.14	67,700,720.88
1.利息收入	76,128,005.83	139,117,429.20
其中:存款利息收入	605,544.75	400,217.39
债券利息收入	75,161,462.79	136,086,845.82
资产支持证券利息收入	341,442.15	420,575.33
买人返售金融资产收人	19,556.14	2,209,790.66
其他利息收入	-	_
2投资收益(损失以"-"填列)	-19,680,931.64	-118,382,477.95
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	_
债券投资收益	-19,766,579.84	-118,382,477.95
资产支持证券投资收益	85,648.20	_
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)	62,590,790.67	21,519,027.17
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
c tháide i / tartini " P. tarni)	2 242 44720	25 446 742 46

2,889,847.

5,431,738.25

. 管理人报酬

销售服务费
 交易费用

7. 其他费用 三、利润总额(99 830 630 9 44 229 902 11 44,229,902.11

会计主体:银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF) 本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	1,220,247,295.81	112,721,733.66	1,332,969,029.47			
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本 期利润)	-	99,830,630.96	99,830,630.95			
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)	186,258,801.73	31,622,172.72	217,880,974.4			
其中:1.基金申购款	959,928,424.37	103,462,773.95	1,063,391,198.3			
2.基金赎回款	-773,669,622.64	-71,840,601.23	-845,510,223.8			
四、本期向基金份額持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以"-"号填列)	-	-110,063,671.64	-110,063,671.6			
五、期末所有者权益(基 金净值)	1,406,506,097.54	134,110,865.69	1,540,616,963.2			
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	4,264,718,018.03	287,701,606.26	4,552,419,624.2			
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本 期利润)	-	44,229,902.11	44,229,902.13			
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)	-3,044,470,722.22	-219,209,774.71	-3,263,680,496.90			
其中:1.基金申购款	29,997,186.74	2,155,125.69	32,152,312.4			
2.基金赎回款	-3,074,467,908.96	-221,364,900.40	-3,295,832,809.3			
四、本期向基金份額持 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)	1,220,247,295.81	112,721,733.66	1,332,969,029.4			

金净值) 报表附注为财务报表的组成部分。 本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署: 王立新 基金管理人负责人 主管会计工作负责 7.4 报表附注

7.4 基金基本特况
7.4 基金基本特况
7.4 基金基本特况
组华地维信用主题债券型证券投资基金(LOF)(以下隐称"本基金"), 系经中国证券监督
管理委员会(以下隐称"中国证监会")证监许可(2012/782号(关于核准银华地债信用主题债
券型证券投资基金(LOF)募集助的批复)的核准,由银华基金管理股份有限公司于2012年7月9日至
2012年2月3日向社会公开募集,基金合同于2012年8月9日至改、本基金为契约型开放式, 存续期
限元。 常定处弃集规模为1.944.874.0283的基金份额。本基金的基金管理 N贵级年基金
管理股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商
组存股份有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商

限外定。自然以益勞或晚份了19年6月,10月以近26切所盡宜財報。查報四計報查管理人力限平衡並 質別股份有限公司。法册登记机构为中国证券登记结局有限责任公司。基金托管人为中国正海 报子配份有限公司。 本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具。但租固内依法发行上市的债券以及法律 法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。但租固内依法发行上市的债券以及法律 法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。但租固协会,中国银币基金 供企业债、公司债、司分离交易可转值的吨值部分,但即融资券。回购、次级债、资产支持证券, 期限在一年以内、合一年。的银行存款,以及法律法规或营留的"方年基金投资的其他的股交 益类金融工具。本基金不投资股票(含一级市场新股中购),权证和可转换公司债券(可分离交 局司转值的纯值部分除外)。本基金的投资组合比例为,本基金负投资任债券资产比例不低于基金 资产的30%,其中,现金不包括结算的行金。存出保证金。成或中 以外的政府债券不低于基金资产单值的5%。其中,现金不包括结算部行金。存出保证金。成或申 规定的股份债券不低于基金资产单值的5%。其中,现金不包括结算部行金,企业债、公司债、 知明施资券,可分离交易司转值的电值部分,资产支持证券等等值价值,决于规划、企业债、公司债、 知明施资券,可分离交易司转值的电值部分,资产支持证券等等值价值,决于规划在金融债 和中央政府代为发行的地方债券之外的,非国家信用的商业企业统法金融工具。如结结核应量 用中央政府代为发行的地方债券之外的,非国家信用的商业企业统法金融工具。如结结核应单位 国际总公后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳人投资范围。 本基金的企业低比较基础的,中继综合指数(全价)。 7.4.2 会计报表的编制基础

会计推测,这用指摘、解释以及基础相关规定(以下医称"企业会计准则"的编码,则时,对于 具体会计检察和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业会全部,对发布的(进步投资基 金会计核原业分解引),中国证金纳宣传可证多价等级要员会关于证券投资基金 业多的指导是见)、《证券投资基金信息投源管理办法》、《证券投资基金信息按离内等与格式 推测)第2号《生度报告的内容》的宏》、《证券投资基金信息按离行图》,

油則 第2号(中度报告的內等与核式)、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表 树注的编制及披露》、《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特级经营为基础制限。 74.3 遵循企业会计准则以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12月31日的财务状况以及2018年度的经营使根料的模型。 为状况以及2018年度的经营使根料的模型,可以 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一效。 74.6 会计政策和安计估计变理以及差错更正的说明 74.6.1 会计政策变更的说明 75.5.1 会计政策变更的说明

元。 7.4.5.2 会计估计变更的说明

7.4.5.3 差错更正的说明

7.4.6.1 增值税 根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》 的规定,对证券投资基金(前时证券投资基金,开放式证券投资基金)管理、运用基金买卖股票、债券的转让收入免证增值税;调体力或股外投资基金)管理、进用基金买卖股票、债券的转让收入免证增值税;调体力或所值利息收入以及金融同业往来多息收入免证增值股,积累利息收入不证收增值税。 规则或密。国家保务后局财税(2016/46号文(关于进一步明确全面推升营改增试点金融报大规划的规划),对股股、海域限券后局财税(2016/46号文(关于进一步明确全面推升营放增试点金融报大规划的通知) 对限股汇。海域排料于展的原理式关入适告金融商品业务及转有返货性金融

业有关政策的遇知,的预定,金融机,每开展的质押式买,及售金融商品业务及持有政策性金融 债券取得的写成处,属于金融时间,但在关系。 根据财政原。国家联务总局财税2001670号文(关于金融机,构同业往来等增值税政策的补 充通到1的预度、金融机构开场2015年2人及16年金融商品。依,同业存款、同业存享、同业存享、成为持有 金融值条款保护行利息收入属于金融同业往来利息收入。 根据财政策。国家联务总局财税2016140至文(关于明金金融。对地产开发、教育辅助服务 等增值税战级的通知为的规定。货管产品运营过和中发生的增值税应税行为。以货管产品管理人

根則財政縣。国家稅务起時時紀20176日40岁又长天下9時至級、房地一万公、48月申助以85分學值稅政稅的週知19的股定、资管产品营資用大生的管稅稅及民行为,以受管产品管理人
为增值稅財稅人。
根則財政際。国家稅券总局財稅201766号文(关于管管产品增值稅有关问題的通知19的规
定、自2018年1月1日起、资管产品管理人、运营资管产品过程中发生的增值稅政稅行为。以等管产品管理
人未分別核資效管产品运建业务平1人运营资管产品过程中发生的增值稅政稅行分。以下管
水等资管产品运建业务平1人运营资管产品过程的发生的的除外,资管产品管理
人未分别核資效管产品运建业务和其他业务价销售额和增值税应税税额的除外,资管产品管理
人用过程分别的成工总核资资管产品运建业务和其他业务价销售额和增值税应税税额的除外,资管产品产品管理
利日前油运营过程中发生的销售股还银行为,未缴购增值税的、不再缴纳;已额税增在股份、已纳 稅額从资管产品管理以从同月份的增值税应税税额中抵减;
根期财政院 国家稅券之股后财务的约约的专文《关于租人固定资产进项税额报托扣等增值税收缴的资金产品营理以从同月份的增值税应税税额中抵减;
根期财政院 国家稅券之股份,权利的企业、全营营等品提供的贷款股务,发出的股份,已纳税率盈利利规定、自2018年1月日起产发生的税分金额的规划,可以股梯按照以下规定销售额。提供贷款股条,以2018年1月日起产生的规分金额利息性原的收入分销售额,将过1017年12月31日前取得的股票,不包括限售股)、债券、基金市物制贷、可以选择按照公司实产人价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日收盈价,他参约股份价格分的企业企业价值的股份价值,基金份额净值,非货物则货值股份产资之人价计算销售额。增值税附加税包括商市维产建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税为计划的股份租赁和股份证益市营税,对股份股份价值税。

限为打代依据,37粉较规定的比约咖啡等。 7.462 企业时得税 根期防设部、国家税务总局财税1200478号文《关于证券投资基金积收政策的通知》的规 自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人 目基金交卖股票、债券的整价收入,继续承征企业所得税。 根据财政部、国家税务总局财税20081号文《关于企业所得税者干扰组成策的通知》的规 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,股权的股起、红

关联方名称	与本基金的关系
西南证券股份有限公司("西南证券")	基金管理人股东、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司 ("第一创 业")	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司("东北证券")	基金管理人股东、基金代销机构
山西海鑫实业股份有限公司	基金管理人股东
杭州银华聚义投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
杭州银华致信投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
杭州银华汇玥投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
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
银华资本管理(珠海横琴)有限公司(注 1)	基金管理人子公司
银华国际资本管理有限公司	基金管理人子公司
深圳银华永泰创新投资有限公司	基金管理人子公司的子公司

注1:由原银华财富资本管理(北京)有限公司于2019年3月4日更名为银华资本管理(珠海横琴库留公司

7.4.8.2 关联方报酬

4.8.2.1 基金管理费		单位:人民币	j
项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
当期发生的基金应支付 的管理费	8,669,541.97	16,295,214.60	
其中:支付销售机构的客 户维护费	160,216.04	276,008.31	
主:基金管理费每日计提	是,按月支付。基金管理费按前	一日的基金资产净值的0.60%的年	艺

率计提。计算方法如下: 单位:人民币元

本期 2018年1月1日至2018年12月 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31 当期发生的基金应支付 9升官数 ::基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费

E为前一日的基金资产净值 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

7.4.8.5 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

期末余額 当期利息收入 期末余額 当期利息收入 中国工商 973,159.43 125,573.26 银行 7.48.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

									金额单位:	人
7.4.9.1.	1 受	限证券	类别:	债券						
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末 估值 单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	1
1550 95	18 皖 投 02	2018 年12 月17 日	201 9年 1月 3日	新债未上市	100.0	100.00	800,000	80,000, 000.00	80,000, 000.00	

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末2018年12月31日止,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501,600,000.00元,于2019年1月2日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的 证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转人质押库的债券,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。 74.10 有助于理解和外所会计报表需要说明的其他事项

74.10.1 公允60届 本基金非以公允价值计量的金融工具,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值 本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币0.00 元。属于第二层次的余额为人民币0.00元。属于第三层次的余额为人民币0.00元 上年度末:第一层次人民币0.00元,第二层次人民币1,341,609,286.90元,第三层次人民币0.00

元)。
(2) 公允价值所属层次间的重大变动
本基金政策为以报任期的作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告
斯特有的以公允价值计量且生变动计人当期抛盘的金融资产。在第一层次和第三层次之间无重
大转换(上年度、无)。本基金本报告期持有的以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资
"74.102 承禧事项

元。 7.4.10.4 财务报表的批准 本财务报表已于2019年3月26日经本基金的基金管理人批准。

			亚视中亚:八片
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	1,968,610, 261.80	96.28
	其中:债券	1,968,610, 261.80	96.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	37,286,510.14	1.82
8	其他各项资产	38,673,559.92	1.89
9	合计	2,044,570,	100.00

注:由于四舍五人的原因,市值占总资产比例分项之和与合计可能有尾差。

注:由于四會五人的原因,市值占这京产比例分项之和与合计可能有尾差。 82. 期末按疗业分类的股票投资租合 82.1 报告期末按疗业分类的境内股票投资组合 注:本基金本报告期末来持有股票。 22.2 报告期末按疗业分类的潜股避投资股票投资组合 注:本基金本报告期末来持有港股通投资股票。 3. 期末按公价值占基金资产增值比例大小排序的所有股票投资明细 注:本基金本报告期末未持有股票。

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	80,229,500.00	5.21
	其中:政策性金融债	80,229,500.00	5.21
4	企业债券	1,093,307,961.80	70.97
5	企业短期融资券	100,258,800.00	6.51
6	中期票据	694,814,000.00	45.10
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,968,610,261.80	127.78

8.6	6 期末按公允	价值占基金的	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
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	155095	18院投02	800,000	80,000,000.00	5.19	
2	101800340	18华润置 地 MTN002B	700,000	73,514,000.00	4.77	
3	101800782	18北控水 务 MTN002A	600,000	61,008,000.00	3.96	
4	122975	09济城建	600,000	60,108,000.00	3.90	
		14苏州相				

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不存在被监管部门立案调查,或在报告 411.1 本级或以及印制于心电力以及行工体本则不计任效应当部 1.5 未明显,成任报日 编制目前一年内受到公开遗济。处即时情况。 811.2 本基金本报告期末未持有股票,因此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。 811.3 期末其他各项资产构成

	777777	单位:人区
序号	名称	金额
1	存出保证金	26,741.98
2	应收证券清算款	216,498.36
3	应收股利	-
4	应收利息	38,409,303.14
5	应收申购款	21,016.44
6	其他应收款	_
7	待摊费用	-
8	其他	_
9	会计	38.673.559.92

9 合计
8.11.4 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可转换债券。
8.11.5 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。

注:本基金本程告期末未持有股票。 8.116.投资信合报告游比的其他文字描述那分 由于四舍五人的原因,比例的分项之和与会计可能有尾差。 § 9.基金份额持有人信息 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

				10 137 CL113					
持有人户 数(户)		户均持有的基		机构投资者		个人投资者			
		金份額	持有份额		占总份額 比例	持有份额		占总份 額比例	
		362,408.17	17 1,342,583,986		95.46%	16% 63,922,		4.54%	
.2 期末	k£7	市基金前十名持	持有人						
序号		持有人名称			持有份额((分)		市总份額 七例	
1	司.	中国太保集团股份有限公司-本级-集团自有资金-012G-ZY001深				527,333.00		12.60%	
2	龚力	亡永			453,400.00		10.84%		
3		5煤电集团有限: を计划 – 农行			341,697.00		8.17%		
4	中国外运华东有限公司企业 年金计划 – 交通银行股份有					256,010.00		6.12%	

项目 基金管理人所有从业人员

持有本基金
94 期末基金管型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,本基金管型人高级管理人员,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基基金份额总量的数量区间为0。

注:总申购份额含红利再投及转换入份额,总赎回份者 § 11 重大事件揭示 本报告期内,无基金份额持有人大会决议。 1.2 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 本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

11.7.1 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

		/IX-97	(.×.90)	E2.X.13 88.93	101H 2 M333Z	
券商名称	交易单元 数量	成交金額	占当期股票 成交总額的 比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
中信证券股 份有限公司	1	-	-	_	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	2	-	=	=	-	新増2个 交易单 元

新増2个 交易単 一发证券股 K吴证券B 基金专

个股分析 2、基金专 批准后与被	报告、市场服务 同交易单元的 大用交易单元的 大选择的证券经	报告以及全面 选择程序为根 营机构签订协	据标准进行考察后,	确定证券約	圣营机构 的i	先择。经
						立:人民币
	债券交	を易	债券回购交	易	权证:	交易
券商名 称	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金額	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
中信证 券股份 有限公 司	698,143, 693.91	99.27%	74,172,900, 000.00	100.00%	-	_
光大证						

东北证 券股份

长城证 券股份 有限公 司

中泰证 券股份 有限公 學股份 有限公 司

兴业证 券股份

投资		报	报告期内持有基金份额变化情况 报告期末持有 情况						
者类別	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	份額 占比		
机构		2018/07/13- 2018/07/24							
	1	2018/08/20 -2018/12/1 2	0.00	267,139, 804.10	0.00	267,139, 804.10	18.99		
	2	2018/01/01- 2018/12/31	457,123, 325.47	0.00	91,240, 876.00	365,882, 449.47	26.01 %		
	3	2018/01/01- 2018/07/12	354,144, 078.24	0.00	354,144, 078.24	0.00	0.00		

《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,少数基金份额特有人所持有的基金份额占比较高,其在召开持有

提出發味电压放逐率使用的自分、5年38点人2018年3月,

122 影响投资法次策的其他恒型信息
1、基金管理从于2018年3月20日经第了《天于修订公司排下部分基金基金合同有关条款及调整赎回限的公告》,修订后的《基金合同》自4次告投布之日起往来。成为不影响原有基金份额的有人员利益、《基金合同》中"水基金对特别特别的少于7日形投资者收取不成于15米的原包据,将基上逐渐现金输引人基金的学"的参索形了2018年4月1日起一次高速,人本基金管理人于2018年6月1日被国务全线上发生。