银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:银华基金管理股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2019年3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。

基金托管人中国工商银行股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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金
基金简称	银华食品饮料量化股票发起式
基金主代码	005235
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	44,250,521.45份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称:	银华食品饮料量化股票发起式A / 银华食品饮料量化股票发起式C
下属分级基金的交易代码:	005235 / 005236
报告期末下属分级基金的份额总额	28,396,951.29份 / 15,853,570.16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,重点投资于食品饮料主题相关的上市公司,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	本基金投资于食品饮料主题,使用主动量化策略对食品饮料主题界定内的股票进行筛选并进行权重的优化,力争在跟踪食品饮料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,以规避投资组合的安全性、收益性与流动性。本基金以获明保值为目的,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%;投资于食品饮料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	中信食品饮料指数收益率×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,属于证券投资基金中风险和预期收益较高的品种,其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年11月9日(基金合同生效日)-2017年12月31日	
	银华食品饮料量化股票发起式A	银华食品饮料量化股票发起式C	银华食品饮料量化股票发起式A	银华食品饮料量化股票发起式C
本期已实现收益	-3,841,294.17	-2,196,539.50	-120,212.85	-23,194.68
本期利润	-7,939,847.14	-4,917,318.88	202,566.86	13,935.93
加权平均基金份额本期利润	-0.3318	-0.3653	0.0168	0.0054
本期加权平均净值利润率	-34.92%	-38.45%	1.69%	0.54%
本期基金份额净值增长率	-19.88%	-19.97%	1.97%	1.91%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末	
期末可供分配利润	-5,197,602.94	-2,923,821.26	-153,613.46	-61,663.68
期末可供分配基金份额利润	-0.1830	-0.1844	-0.0104	-0.0110
期末基金资产净值	23,199,348.35	12,929,748.90	14,995,942.26	5,697,180.69
期末基金份额净值	0.8170	0.8156	1.0197	1.0191
3.1.3 累计期末指标	2018年末		2017年末	
基金份额累计净值增长率	-18.30%	-18.44%	1.97%	1.91%

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率与其与同期业绩比较基准收益率的比较

银华食品饮料量化股票发起式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
过去三个月	-16.25%	2.09%	-15.65%	2.17%	-0.60%	-0.08%
过去六个月	-22.03%	1.90%	-19.63%	1.87%	-2.40%	0.03%
过去一年	-19.88%	1.78%	-18.16%	1.74%	-1.72%	0.04%
自基金合同生效起至今	-18.30%	1.70%	-16.12%	1.72%	-2.18%	-0.02%

银华食品饮料量化股票发起式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
过去三个月	-16.26%	2.09%	-15.65%	2.17%	-0.61%	-0.08%
过去六个月	-22.14%	1.90%	-19.63%	1.87%	-2.51%	0.03%
过去一年	-19.97%	1.78%	-18.16%	1.74%	-1.81%	0.04%
自基金合同生效起至今	-18.44%	1.70%	-16.12%	1.72%	-2.32%	-0.02%

注:中信食品饮料指数收益率×90%+商业银行人民币活期存款利率(税后)×10%

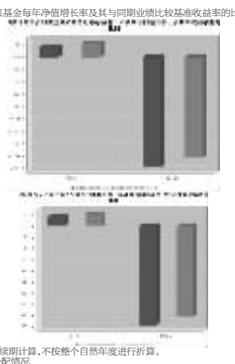
基金股票部分主要投资于食品饮料主题的股票。中信食品饮料指数基本反应了沪深A股中食品和饮料主题股票的整体表现,对本基金定义的食品饮料主题具有较强的代表性,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。

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%的现金或到期日在一年以内的政府债券。政府债券比较基准中给予投资主题相匹配的指数收益率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收益表现的权重。

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%;投资于食品饮料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%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金于本报告期及上年度可比期间2017年11月9日(基金合同生效日)至2017年12月31日止均未进行利润分配。

§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%、山西鑫鼎实业股份有限公司10.90%。截至2018年末,公司管理资产规模位列业内第一位,管理公募基金数量位列业内第二位,管理社保基金、企业年金、基本养老保险基金、特定客户资产管理、QDII、QFII等多类别资产管理业务资格,是业内少数具备全牌照资产管理资格的公司之一。

截至2018年12月31日,本基金管理人管理着111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、银华深证100指数分级证券投资基金、银华中证500指数分级证券投资基金、银华深证100价格优势分级证券投资基金、银华中证500价格优势分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金(LOF)、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、银华信用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)、银华空间宝市场基金、银华信用四季债券型证券投资基金、银华中证债券指数增强分级证券投资基金、银华中证中国央企指数分级证券投资基金、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、银华鼎利货币市场基金、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、银华中证智能90指数证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、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、银华证券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、银华生命科技混合型证券投资基金、银华中证800医药指数分级证券投资基金、银华中证800金融指数分级证券投资基金、银华定期开放债券型证券投资基金、银华运景债券型证券投资基金、银华双动力债券型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐定期开放混合型发起式证券投资基金、银华全球视野混合型证券投资基金、银华中证港股通高股息精选指数证券投资基金、银华深证成指分级证券投资基金、银华中证500医药卫生指数证券投资基金、银华信息安全主题混合型证券投资基金、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、银华鑫安定期开放混合型证券投资基金、银华鑫裕定期开放混合型证券投资基金、银华鑫瑞定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5年期国债指数证券投资基金、银华中债-10年期国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级信用债指数证券投资基金、银华茂元定期开放混合型证券投资基金、银华新能源汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华优享产业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、银华科普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、银华稳健明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、银华瑞泽灵活配置混合型证券投资基金、银华多主题开放混合型证券投资基金、银华多元收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华聚多多灵活配置混合型证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华利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、银华融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、银华瑞丽改革混合型发起式证券投资基金、银华罗盈定期开放债券型证券投资基金、银华个旧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、银华稳利养老目标日期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。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		
马君女士	本基金的基金经理	2017年11月9日	-	10年	硕士学位。2006年7月至2009年3月任职大成基金管理有限公司助理金融工程师。2009年3月加盟银华基金管理有限公司,曾担任研究员及基金经理助理职务。自2012年9月4日起担任银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金基金经理,2013年12月16日至2015年7月16日兼任银华消费主题分级股票型证券投资基金基金经理,2015年8月6日至2016年8月5日兼任银华中证国防安全指数分级证券投资基金基金经理,2015年8月13日至2016年8月5日兼任银华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理。自2016年1月14日起兼任银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)基金经理。自2017年9月15日起兼任银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。自2017年11月9日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。自2017年11月9日起兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。自2018年5月11日起兼任银华中小市值量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理。其有从业资格。国籍:中国。
杨腾先生	本基金的基金经理助理	2017年11月9日	-	6.5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,历任量化投资部基金经理助理。其有从业资格。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。

3.本基金管理人于2019年2月13日发布公告,马君女士已结束休假(产假),自2019年2月11日起恢复履行本基金基金经理职务。

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》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其外项实施准则、《银华基金风险管理及内控制度》、《银华基金管理股份有限公司证券投资基金内部交易管理制度》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 公平交易制度和控制方法

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》,本基金管理人制定了公司层面的《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》、对投资端、固定收益部、量化投资部、研究部、交易管理部、监察稽核部等相关所有业务部门进行了制度上的约束。该制度适用于本基金管理人所管理的公募基金、社保组合、企业年金及特定客户资产管理组合等,规范的范围包括但不限于境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时包括投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理流动相关的各个环节。

为了规范本基金管理人各投资组合的证券投资指令的执行过程,完善公平交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》,规定了《银华基金管理股份有限公司公平交易执行制度》,规定了公平交易的执行流程及特殊情况的审批机制;明确了交易执行环节的集中交易制度,并对交易执行环节的内部控制措施进行了完善。

此外,为了加强对异常交易行为的监控,本基金管理人还制定了《银华基金管理股份有限公司异常交易监控实施细则》,规定了异常交易监控的范围以及异常交易发生后的分析、说明、报备流程。

对照2011年8月份新修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人又对上述制度进行了修改完善,进一步明订了公平交易的范围,修订了对不同投资组合同日反向交易的监控重点,并强调了本基金管理人内部控制的要求,具体控制方法为:1.交易所市场的公平交易均通过恒生交易系统实现,不涉及任何人的判断,所有交易均通过恒生投资系统公平交易模块电子化强制执行,公平交易程序自动启动;2.一般情况下,场外交易指令以组合的名义下达,执行交易员以组合的名义进行一般市场申购执标及二级市场交易,并确保非集中竞价交易与投资组合一一对应,且各投资组合获得公平的交易机会;3.对于部分债券一级市场申购,非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,交易管理部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4.本基金管理人使用恒生OS2系统的公平交易稽核分析模块,定期及不定期进行报告分析,对公平交易的执行检查,以期规避作弊流程,达成公平交易的目的要求。

综上所述,本基金管理人通过事前构建控制环境、事中强化落实执行、事后进行双重监督,采确保公平交易制度得到切实执行。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.2.1 整体执行情况说明

报告期内,本基金管理人根据《银华基金管理股份有限公司公平交易制度》及相关配套制度,在研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节,建立了健全有效的公平交易执行体系,公平对待旗下的每一个投资组合。具体执行情况如下:

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。

在投资决策环节,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。

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情况。

4.3.2.2 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3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

在报告期内,我们积极改进已有开发的量化投资管理系统,采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比校验、风险优化等一系列事件。除此之外运用自行开发的量化投资模型,精选部分子行业个股,力争实现超越行业的阿尔法收益。

在2018年中,随着贸易战的持续发酵叠加去杠杆带来的信用收缩,股票市场呈现出熊星下跌的走势,宏观经济层面,PPI、信贷等数据持续走低,企业盈利水平相应下行。市场中的避险情绪较为明显,主要资基指数均为全年负收益。2018全年,上证综指下跌24.59%,沪深300指数下跌25.3%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末银华食品饮料量化股票发起式A基金份额净值为0.8170元,本报告期基金份额净值增长率为-19.88%;截至本报告期末银华食品饮料量化股票发起式C基金份额净值为0.8156元,本报告期基金份额净值增长率为-19.97%;同期业绩比较基准收益率为-18.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年我们认为,市场有望逐步改变2018年的单边下行趋势,在年内大概率状态转向震荡。外部市场方面,随着美国经济转入下行周期,知周内会增加国内的避险情绪;而国内方面,从政策放松到企业利润的修复需要一定的时间周期,但长期来看,中美贸易战正在逐步走向缓和,国内经济的新旧更替也正在发生。经济复苏的衡量过程,将集中体现在上市公司的业绩上,进而为市场带来活跃度和投资机会。经济转轨效应对白酒、乳制品的效果产生一定的压力,但随着减税降费等政策的落地,居民实际收入的增长,消费升级仍然是驱动行业发展的长期趋势。行业细分龙头仍将有望获得超额收益。

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告,以保证基金份额净值的正确性、及时性。

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。估值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

本基金于本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金投资运遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,银华食品饮料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食品饮料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。

4.9 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

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食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金2018年年度报告中财务指标、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 审计报告

本基金2018年度财务会计报告经安永华明会计师事务所(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,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

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	3,910,485.35	5,348,285.39
结算备付金	45,328.09	406,073.19
存出保证金	12,070.14	2,541.20
交易性金融资产	32,403,290.87	15,442,435.30
其中:股票投资	32,403,290.87	15,442,435.30
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	933.44	1,398.35
应收股利	-	-
应收申购款	38,300.53	70,698.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	36,410,408.42	21,271,432.37

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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	57,347.99	535,448.47
应付管理人报酬	31,462.61	13,035.45
应付托管费	3,146.28	1,303.55
应付销售服务费	4,461.09	1,020.38
应付交易费用	29,832.63	17,500.28
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	155,060.57	10,001.29
负债合计	281,311.17	578,309.42
所有者权益:		
实收基金	44,250,521.45	20,297,111.23
未分配利润	-8,121,424.20	396,011.72
所有者权益合计	36,129,097.25	20,693,122.95
负债和所有者权益总计	36,410,408.42	21,271,432.37

注:报告截止日2018年12月31日,银华食品饮料量化股票发起式A类基金份额净值人民币0.8170元,银华食品饮料量化股票发起式C类基金份额净值人民币0.8156元;基金份额总额44,250,521.45份,其中银华食品饮料量化股票发起式A类基金份额总额28,396,951.29份,银华食品饮料量化股票发起式C类基金份额总额15,853,570.16份。

7.2 利润表

会计主体:银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

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11月9日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	-12,017,419.29	271,786.15
1.利息收入	28,291.21	16,453.75
其中:存款利息收入	27,966.83	5,802.13
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	324.38	10,651.62
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-5,554,167.41	-114,767.24
其中:股票投资收益	-6,155,010.91	-114,767.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	600,843.50	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-6,819,332.35	359,910.32
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	327,789.26	10,189.32
减:二、费用	839,746.73	55,283.36
1. 管理人报酬	353,754.01	20,729.61
2. 托管费	35,375.35	2,072.99
3. 销售服务费	51,010.17	1,481.74
4. 交易费用	251,607.27	20,964.02
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	147,999.93	10,035.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-12,857,166.02	216,502.79
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-12,857,166.02	216,502.79

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

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)	20,297,111.23	396,011.72	20,693,122.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	-12,857,166.02	-12,857,166.02
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)	23,953,410.22	4,339,730.10	28,293,140.32
其中:1.基金申购款	97,636,060.86	2,813,754.09	100,449,814.95
2.基金赎回款	-73,682,650.64	1,525,976.01	-72,156,674.63
四、本期末所有者权益(基金净值)	44,250,521.45	-8,121,424.20	36,129,097.25

项目	上年度可比期间 2017年11月9日(基金合同生效日)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)	13,526,775.40	-	13,526,775.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	216,502.79	216,502.79
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)	6,770,335.83	179,508.93	6,949,844.76
其中:1.基金申购款	7,636,134.20	192,748.41	7,828,882.61
2.基金赎回款	-865,798.37	-13,239.48	-879,037.85
四、本期末所有者权益(基金净值)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	20,297,111.23	396,011.72	20,693,122.95

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 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银华食品饮料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]1072号《关于准予银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金注册的批复》的注册,由银华基金管理股份有限公司于2017年10月16日至2017年11月3日向社会公开募集。募集资金业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2017)验字第60468687_A22号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年11月9日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的银华食品饮料量化股票发起式A类基金份额已收到首次募集和降认购费后的有效净认购金额为人民币11,495,504.32元,折合11,495,504.32份银华食品饮料量化股票发起式A类基金份额;有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币3,218.73元,折合3,218.73份银华食品饮料量化股票发起式A类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币11,498,723.05元,折合11,498,723.05份银华食品饮料量化股票发起式A类基金份额。银华食品饮料量化股票发起式C类基金份额已收到的有效净认购金额为人民币2,027,820.22元,折合2,027,820.22份银华食品饮料量化股票发起式C类基金份额;有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币232.13元,折合232.13份银华食品饮料量化股票发起式C类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币2,028,052.35元,折合2,028,052.35份银华食品饮料量化股票发起式C类基金份额。银华食品饮料量化股票发起式A类基金份额和银华食品饮料量化股票发起式C类基金份额收到的实收基金合计人民币13,526,775.40元,合计折合13,526,775.40份银华食品饮料量化股票发起式基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构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。

本基金根据所收取的认购费用、申购费用、销售服务费用方式的差异,将基金份额分为A类和C类不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时收取认购、申购费用而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、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、资产支持证券、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(但国符合中国证监会相关规定)。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%;投资于食品饮料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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。待基金投资其他品种的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致,并在履行适当程序后,参与该类业务,以提高投资收益及进行风险管理。届时,基金投资其他品种的风险控制原则,费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项,将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。业绩比较基准:中信食品饮料指数收益率×90%+商业银行人民币活期存款利率(税后)×10%。

7.4.2 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、