

基金管理人：银华基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：2019年7月19日

基金管理人的董事及董监高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。  
本公司及所聘任的会计师事务所、基金托管人声明本基金合同规定，于2019年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，确认本报告内不存在虚假记载、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。

本公司旗下所有基金的客户服务电话均为95365。

基金合同约定2019年6月1日起至6月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称 银华纯债信用债券(LOF)

场内简称 银华纯债

交易代码 161820

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2012年9月6日

报告期末基金份额总额 1,852,491,627.94份

投资目标 本基金通过对宏观经济及企业财务状况进行分析，对信用投资券品种“自下而上”相结合的投资策略，通过精选的债券品种，重点关注信用品种的利率风险、信用风险度和定价，同时结合市场的流动状况，利用信用品种定价的相对优势，对溢价率较高的品种进行投资。

本基金的投资比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中信用投资券不低于本基金资产的80%；本基金持现金或到期日在一年以内（含一年）的政府债券不高于基金资产净值的5%。

业绩比较基准 中债综合全价(全价)指数。

风险收益特征 本基金为纯债基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期收益率预期低于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人 银华基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 13,306,367.67

2.本期利润 14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附注四、10.2 公允价值收入的确认和计量。

2.本期利润指根据《企业会计准则》计算的净利润，即本期利润=本期已实现收益+本期公允价值变动收益+本期投资收益。

3.加权平均基金份额本期利润=本期利润/期末基金份额总额。

4.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年4月1日～2019年6月30日)

1.本期已实现收益 -13,306,367.67

2.本期利润 -14,805,966.23

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0087

4.期末基金份额净值 2,078,307,931.56 1.122

注：1.本期已实现收益指收入包含公允价值变动收益的利息收入、股息红利收入、债券利息收入、赎回费收入、其他收入等，计算公式参见本报告附