

银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金

2018 年年度报告

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

§1 重要提示及目录

1.1 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
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	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
8.6 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	54
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	54

8.8 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贵金属投资明细	54
8.9 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	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
8.12 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	56
§10 开放式基金份额变动	57
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
11.2 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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 其他重大事件	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息	70
12.1 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	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华和谐主题混合
基金主代码	180018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 4 月 27 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	142,791,641.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险的前提下获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	国家的政策导向将推动特定行业的增长，改善其经济效益；这些行业中的龙头企业受益更为明显，投资于这些企业将能取得较好的回报。因此，本基金将采取积极、主动的资产配置策略，注重风险与收益的平衡，重点投资受益于“构建和谐社会”政策相关行业的股票和具有较高投资价值的固定收益类资产，力求实现基金财产的长期稳定增值。 本基金的投资比例为：股票等权益类资产占基金资产比例为 30%-80%，债券等固定收益类资产占基金资产比例为 15%-65%，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%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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
注册地址		广东省深圳市深南大道	北京市西城区复兴门内大街

	6008 号特区报业大厦 19 层	55 号
办公地址	北京市东城区东长安街 1 号 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100738	100140
法定代表人	王珠林	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通 合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广 场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广 场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

§ 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	2016 年
本期已实现收益	-9,140,477.04	22,416,350.23	-9,506,435.78
本期利润	-52,746,969.90	57,386,523.69	-19,636,968.84
加权平均基金份额本期利润	-0.4033	0.4098	-0.1249
本期加权平均净值利润率	-19.29%	20.65%	-7.07%
本期基金份额净值增长率	-17.63%	23.09%	-6.41%
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	117,306,706.42	145,895,759.97	121,940,305.90
期末可供分配基金份额利润	0.8215	1.2117	0.7972
期末基金资产净值	260,098,347.54	266,305,449.59	274,901,445.47
期末基金份额净值	1.822	2.212	1.797
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	96.10%	138.07%	93.40%

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 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	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	-12.32%	1.52%	-5.43%	0.89%	-6.89%	0.63%
过去六个月	-14.54%	1.42%	-5.94%	0.81%	-8.60%	0.61%
过去一年	-17.63%	1.28%	-10.72%	0.73%	-6.91%	0.55%
过去三年	-5.10%	1.02%	-6.12%	0.65%	1.02%	0.37%
过去五年	45.64%	1.32%	35.25%	0.84%	10.39%	0.48%
自基金合同生效起至今	96.10%	1.25%	37.22%	0.83%	58.88%	0.42%

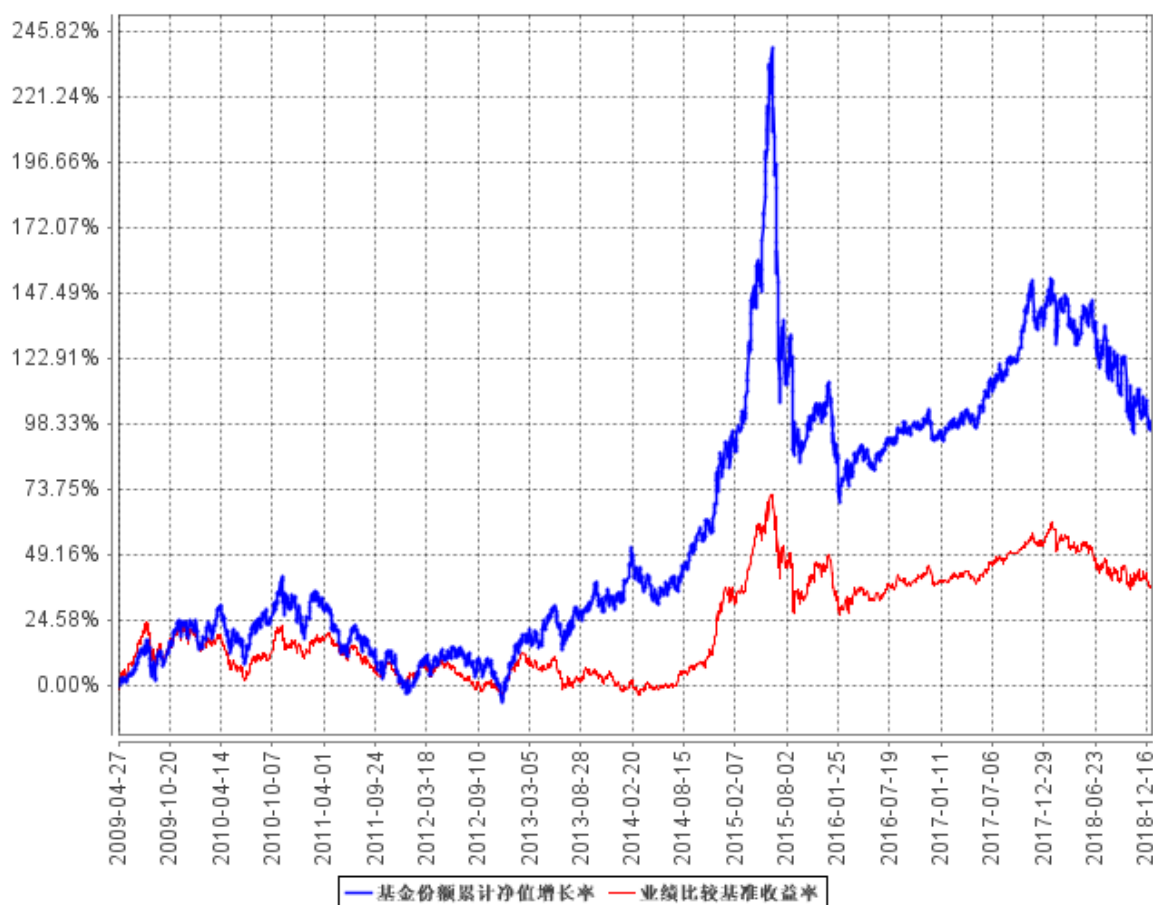
注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+中国债券总指数收益率×45%。

由于本基金投资于股票等权益类资产占基金资产比例为 30%-80%，在实际投资运作中，其中间值

55%为本基金在均衡市场情况下的股票投资比例，在此基础上本基金再根据不同市场情况下各项大类资产的预期风险和收益水平对该比例进行动态调整，故本基金采取 55%作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重，相应将 45%作为衡量债券投资部分业绩表现的权重，这一比例设置足以清晰反映出本基金组合注重均衡资产配置的特性。

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

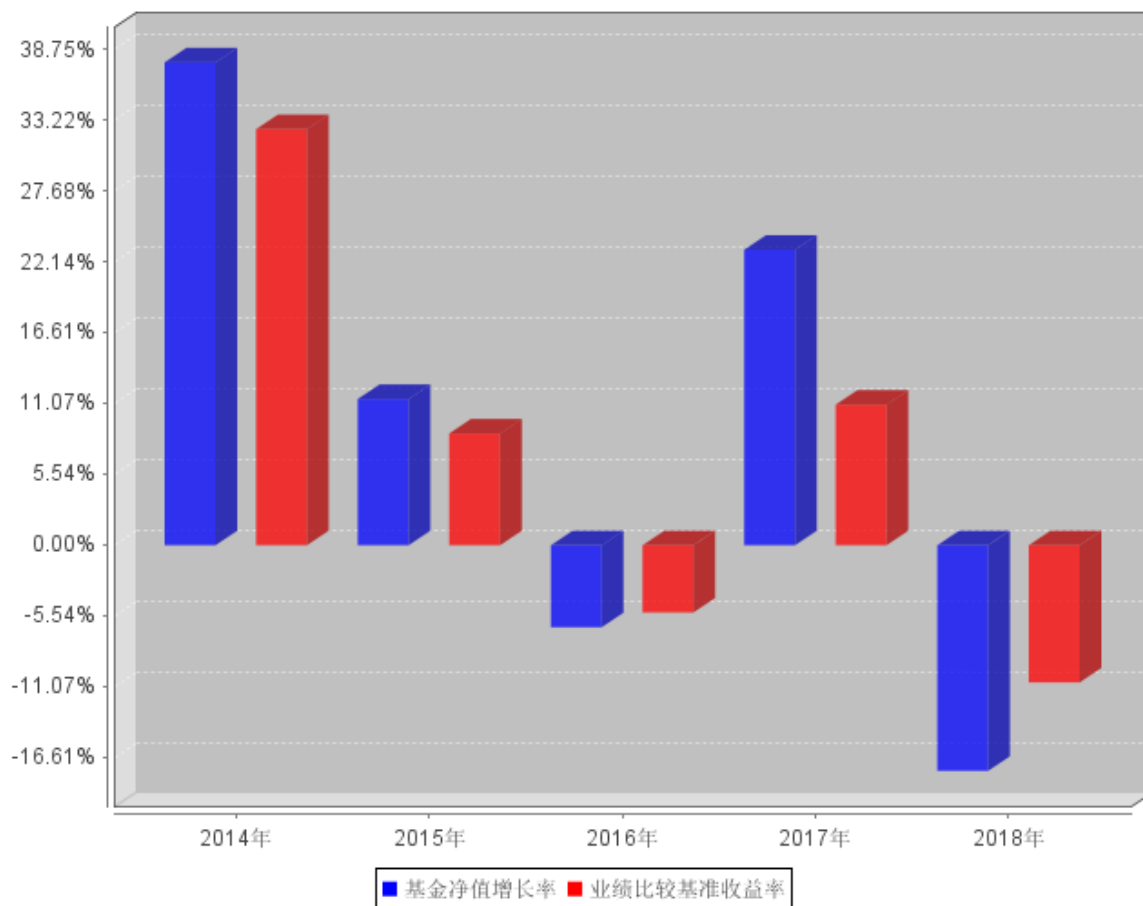
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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：股票等权益类资产占基金资产比例为 30%–80%，债券等固定收益类资产占基金资产比例为 15%–65%，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 过去五年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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2018 年度、2017 年度及 2016 年度均未进行利润分配。

§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%，山西海鑫实业股份有限公司 0.90%，杭州银华聚义投资合伙企业（有限合伙）3.57%，杭州银华致信投资合伙企业（有限合伙）3.20%，杭州银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）3.22%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

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、银华全球核心优选证券投资基金、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、银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、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、银华纯债信用主题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）、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、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、银华惠增利货币市场基金、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、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银

华汇利灵活配置混合型证券投资基金、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、银华逆向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、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华双动力债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、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、银华惠安定期开放混合型证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融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 信用债指数证券投资基金、银华明择多策略定期开放混合型证券投资基金、银华智能汽车量化优选股票型发起式证券投资基金、银华信息科技量化优选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、银华农业产业股票型发起式证券投资基金、银华智荟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、银华稳健增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、银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金、银华岁丰定期开放债券型发起式证券投资基金、银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华心诚灵活配置混合型证券投资基金、银华积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、银华混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、银华国企改革混合型发起式证券投资基金、银华岁盈定期开放债券型证券投资基金、银华心怡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、银华裕利混合型发起式证券投资基金、银华尊和养老目标日期 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		
唐能先生	本基金的基金经理	2015 年 5 月 25 日	—	9 年	硕士学位。2009 年 9 月加盟银华基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理职务。自 2015 年 5 月 25 日起担任银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 12 月 27 日起兼任银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
周可彦先生	本基金的基金经理	2015 年 5 月 6 日	2018 年 12 月 27 日	16 年	硕士学位。历任中国银河证券有限公司研究员，申万巴黎基金管理有限公司高级分析师，工银瑞信基金管理有限公司高级分析师，嘉实基金管理有限公司高级分析师，曾担任嘉实泰和价值封闭式基金基金经理职务，华夏基金管理有限公司投资经理，天弘基金管理有限公司投资部总经理，曾担任天弘精选混合型证券投资基金基金经理职务。2013 年 8 月加盟银华基金管理有限公司。自 2013 年 10 月 22 日至 2018 年 12 月 27 日担任银华富裕主题混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 5 月 6 日至 2018 年 12 月 27 日兼任银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 8 月 10 日至 2018 年 12 月 27 日兼任银华沪港深增长股票型证券投资基金基金经理，自 2018 年 2 月 8 日至 2018 年 12 月 27 日兼任银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2018 年 4 月 26 日至 2018 年 12 月 27 日兼任银华瑞和灵活配置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》、《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》及其各项实施准则、《银华和谐主题灵活配置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 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》，对投资部、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，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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》，制定了《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日常监控，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，进一步修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，不掺杂任何的人为判断，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级市场申购投标及二级市场交易，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 03.2 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，对公平交易的情况进行检查，以规范操作流程，适应公平交易的需要。

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，来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 同向交易价差专项分析

本基金管理人对旗下所有投资组合过去四个季度不同时间窗内（1 日内、3 日内及 5 日内）同向交易的交易价差从 T 检验（置信度为 95%）和溢价率占优频率等方面进行了专项分析，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.3 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的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

2018 年对于股票市场来说是不平凡的一年，开年气势如虹，以上证 50 为代表的大蓝筹在 1 月份大涨，随后的 11 个月里一路下跌，贯穿全年，最强的上证 50 指数，在 2018 年底基本上回到了 2017 年年初的水平，回头来看，2018 年的开年是 2016 年到 2017 年这一轮大蓝筹上涨最后的疯狂。2018 年不仅仅是暴跌的一年，而是先大涨后暴跌，之后的计算机板块，三线白酒板块和医药板块，都出现了类似行情。这也给理性投资者一个比较好的卖出机会，但是对于追涨的投机者来说是重大打击，亏损幅度可能还要大于板块指数的跌幅。

股票是宏观经济的晴雨表，从宏观经济角度，2018 年是中国经济周期是从复苏走向衰退的一年，在政府去杠杆的推进，压缩表外资产，调控房地产，控制地方政府举债规模，宏观经济数据持续下行，特别是 2018 年下半年，社会融资规模大幅低于预期，社会零售总额持续低于预期，加上美国贸易战的巨大不确定性，宏观经济的悲观反映在股票市场得到了放大，政府的宏观调整政策已经开始转向，由紧变松，并加大力度，但是股票市场还在惯性下跌。

本基金全年维持中等偏高的仓位，坚持以长期业绩增长为标准的投资风格，不做短期博弈，重点投资大蓝筹和快速成长的行业龙头，主要布局了大消费、大金融、科技和高端制造板块，跑赢了指数。

4.4.2 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 1.822 元；本报告期基金份额净值增长率为-17.63%，业绩比较基准收益率为-10.72%。

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，经济没有那么悲观。在前期供给侧改革背景下，这一轮经济复苏过程中，产能增加有限，库存上升较弱，因此，这一轮宏观经济调整的深度应该弱于上一轮。从 2018 年三季度开始，政府的经济支持政策逐步落地，货币政策上，召开民营经济座谈会，号召银行加大对民企贷款支持，再到推出中期借贷便利，政策从以去杠杆为重心到从货币向信用的传到为重心，财政政策方面，逐步推出大幅度的减费降税，以增强市场经济活力，增加专项地方债的规模，给经济托底。因此，宏观经济没有市场预期的那么悲观，社会融资规模有望 2019 年逐步小幅回升，

贸易战的缓和和经济预期的短期向上调整，市场在低位反弹的概率较大，本基金在 2019 年将保持中等偏上的仓位。

我们投资选择的两个标准，第一，市场格局好的行业，具有护城河高，品牌溢价能力强的优质公司；或者第二，增速较快的成长行业里最优优秀的公司。我们主要投资四个方向：大消费、金融、科技和高端制造。坚持长期业绩增长投资，不做短期博弈，分享优质公司长期业绩增长带来的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步健全了风险控制和监察稽核机制，根据不同基金的特点与发展情况，及时界定新的风险点，评价风险级别，并纳入稽核计划。首先，本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础，对本基金的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，并对其他业务环节进行不定期抽查。“季度监察稽核项目表”由各部门风险控制管理员组织关键岗位业务人员填报自查结果，部门总监签字确认后将稽核结果报督察长及公司总经理。在持续关注对“季度监察稽核项目”表中识别的风险点进行自查的同时，还定期进行有重点的检查。在投资研究交易环节，持续进行对研究报告合规性的检查、对股票库建立及完善的跟踪检查，并对基金的投资比例进行日常监控，对关联交易的日常维护，对基金持仓流动性风险定期关注，并对公平交易执行情况进行检查等等；在营销与销售方面，本基金管理人定期对本基金宣传推介材料的合规性和费率优惠业务等进行检查；在基金的运作保障方面，本基金管理人通过加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的检查来确保本基金财务数据的准确性。上述检查中发现问题的会通过口头改进建议、不符合事项书面跟踪检查报告或警示报告的形式，及时将潜在风险通报部门总监、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。

与此同时，本基金管理人严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，确保信息披露的真实、完整、准确、及时。

4.7 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布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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验。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。运作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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，银华和谐主题灵活配置混合型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和谐主题灵活配置混合型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。本报告期内，银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

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和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2019）审字第 60468687_A10 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项

	（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金不能

	持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	贺 耀
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	7.4.7.1	13,511,711.32	19,094,373.97
结算备付金		883,124.50	496,853.45
存出保证金		139,078.79	256,656.18
交易性金融资产	7.4.7.2	247,940,993.78	215,328,345.29
其中：股票投资		197,820,993.78	165,724,345.29
基金投资		-	-
债券投资		50,120,000.00	49,604,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	37,632,828.63
应收利息	7.4.7.5	1,270,256.23	615,681.45
应收股利		-	-
应收申购款		18,788.58	29,196.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		263,763,953.20	273,453,935.00
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		999,754.55	4,516,470.63
应付赎回款		132,862.94	141,336.49
应付管理人报酬		340,621.28	340,631.56
应付托管费		56,770.20	56,771.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	351,867.20	309,789.22
应交税费		1,386,000.00	1,386,000.00
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	397,729.49	397,485.59
负债合计		3,665,605.66	7,148,485.41
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	142,791,641.12	120,409,689.62
未分配利润	7.4.7.10	117,306,706.42	145,895,759.97
所有者权益合计		260,098,347.54	266,305,449.59
负债和所有者权益总计		263,763,953.20	273,453,935.00

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.822 元，基金份额总额

142,791,641.12 份。

7.2 利润表

会计主体：银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金

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	附注号	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、收入		-45,236,797.12	66,357,250.29
1. 利息收入		1,938,424.53	2,523,498.30
其中：存款利息收入	7.4.7.11	190,876.68	302,840.26
债券利息收入		1,730,134.25	2,033,586.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,413.60	187,071.72
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,595,651.17	28,852,501.85
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-6,762,092.03	27,319,708.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	295,050.00	-929,210.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,871,390.86	2,462,003.09
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-43,606,492.86	34,970,173.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	26,922.38	11,076.68
减：二、费用		7,510,172.78	8,970,726.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,098,929.11	4,163,465.22

2. 托管费	7.4.10.2.2	683,154.84	693,910.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,337,571.88	3,721,982.93
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	7.4.7.20	390,516.95	391,367.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-52,746,969.90	57,386,523.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-52,746,969.90	57,386,523.69

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金

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）	120,409,689.62	145,895,759.97	266,305,449.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-52,746,969.90	-52,746,969.90
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）	22,381,951.50	24,157,916.35	46,539,867.85
其中：1. 基金申购款	41,002,098.21	45,877,996.53	86,880,094.74
2. 基金赎回款	-18,620,146.71	-21,720,080.18	-40,340,226.89
四、本期向基金份额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）	142,791,641.12	117,306,706.42	260,098,347.54
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）	152,961,139.57	121,940,305.90	274,901,445.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,386,523.69	57,386,523.69
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）	-32,551,449.95	-33,431,069.62	-65,982,519.57
其中：1. 基金申购款	9,277,642.41	9,822,801.23	19,100,443.64
2. 基金赎回款	-41,829,092.36	-43,253,870.85	-85,082,963.21
四、本期向基金份额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）	120,409,689.62	145,895,759.97	266,305,449.59

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

银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金（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[2009]126号文《关于核准银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于2009年3月26日至2009年4月22日向社会公开募集，基金合同于2009年4月27日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为2,672,979,485.72份基金份额。本基金的基金管理人和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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳

入投资范围。股票等权益类资产占基金资产比例为 30%-80%，债券等固定收益类资产占基金资产比例为 15%-65%，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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 55%+中国债券总指数收益率 $\times$ 45%。

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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及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 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的

金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行

重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计

算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/[(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方

法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 30%，若基金合同生效不满三个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4)基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(5)每一基金份额享有同等分配权；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

7.4.6.2 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（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》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税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税

额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，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）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	13,511,711.32	19,094,373.97
定期存款	—	—
其中：存款期限 1 个月以内	—	—
存款期限 1-3 个月	—	—

存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	13,511,711.32	19,094,373.97

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		227,502,871.03	197,820,993.78	-29,681,877.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	49,866,060.00	50,120,000.00	253,940.00
	合计	49,866,060.00	50,120,000.00	253,940.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		277,368,931.03	247,940,993.78	-29,427,937.25
项目		上年度末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		151,432,619.68	165,724,345.29	14,291,725.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	49,717,170.00	49,604,000.00	-113,170.00
	合计	49,717,170.00	49,604,000.00	-113,170.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		201,149,789.68	215,328,345.29	14,178,555.61

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,133.79	10,722.04
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	437.14	245.96
应收债券利息	1,266,616.44	622,000.00
应收资产支持证券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	-17,413.60
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	68.86	127.05
合计	1,270,256.23	615,681.45

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	351,867.20	309,789.22
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	351,867.20	309,789.22

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	334.01	90.11
预提费用	350,000.00	350,000.00
其他	47,395.48	47,395.48
合计	397,729.49	397,485.59

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	120,409,689.62	120,409,689.62
本期申购	41,002,098.21	41,002,098.21
本期赎回（以“-”号填列）	-18,620,146.71	-18,620,146.71
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	142,791,641.12	142,791,641.12

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	164,539,906.71	-18,644,146.74	145,895,759.97
本期利润	-9,140,477.04	-43,606,492.86	-52,746,969.90
本期基金份额交易产生的变动数	31,749,960.07	-7,592,043.72	24,157,916.35
其中：基金申购款	57,861,265.02	-11,983,268.49	45,877,996.53
基金赎回款	-26,111,304.95	4,391,224.77	-21,720,080.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	187,149,389.74	-69,842,683.32	117,306,706.42

7.4.7.11 存款利息收入

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 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	176,390.52	277,487.87
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	12,053.10	22,243.13
其他	2,433.06	3,109.26

合计	190,876.68	302,840.26
----	------------	------------

7.4.7.12 股票投资收益

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1月1日至 2017年12月31日
卖出股票成交总额	785,347,213.43	1,285,965,268.58
减：卖出股票成本总额	792,109,305.46	1,258,645,559.82
买卖股票差价收入	-6,762,092.03	27,319,708.76

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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1月1日至2017年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	295,050.00	-929,210.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	295,050.00	-929,210.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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1月1日至2017年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	51,343,236.44	52,073,150.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	49,717,170.00	50,946,500.00
减：应收利息总额	1,331,016.44	2,055,860.28
买卖债券差价收入	295,050.00	-929,210.00

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

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 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,871,390.86	2,462,003.09
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,871,390.86	2,462,003.09

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-43,606,492.86	34,970,173.46
——股票投资	-43,973,602.86	34,521,843.46
——债券投资	367,110.00	448,330.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-43,606,492.86	34,970,173.46

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	18,615.85	8,937.75
转换费收入	8,306.53	2,138.93
合计	26,922.38	11,076.68

7.4.7.19 交易费用

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 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,336,421.88	3,720,682.93
银行间市场交易费用	1,150.00	1,300.00
交易基金产生的费用	—	—
其中：申购费	—	—
赎回费	—	—
合计	2,337,571.88	3,721,982.93

7.4.7.20 其他费用

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 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行费用	3,316.95	4,167.61
合计	390,516.95	391,367.61

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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	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：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）有限公司。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
东北证券	212,026,271.40	12.82%	—	—

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券	155,054.24	11.04%	4,319.99	1.23%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

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	4,098,929.11	4,163,465.22
其中：支付销售机构的客户维护费	862,973.23	905,143.05

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

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1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	683,154.84	693,910.84

注：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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总份 额的比例
银华 资本 管理 (珠 海横 琴) 有限 公司	9,007,088.54	6.31%	—	—

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.10.5 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

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银	13,511,711.32	176,390.52	19,094,373.97	277,487.87

行				
---	--	--	--	--

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，使得本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），在正常市场条件下其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1- 3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	13,511,711.32	-	-	-	-	-	13,511,711.32
结算备付金	883,124.50	-	-	-	-	-	883,124.50
存出保证金	139,078.79	-	-	-	-	-	139,078.79
交易性金融 资产	-	-	50,120,000.00	-	-	197,820,993.78	247,940,993.78
应收利息	-	-	-	-	-	1,270,256.23	1,270,256.23
应收申购款	-	-	-	-	-	18,788.58	18,788.58
资产总计	14,533,914.61	-	50,120,000.00	-	-	199,110,038.59	263,763,953.20
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	999,754.55	999,754.55
应付赎回款	-	-	-	-	-	132,862.94	132,862.94
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	340,621.28	340,621.28
应付托管费	-	-	-	-	-	56,770.20	56,770.20
应付交易费 用	-	-	-	-	-	351,867.20	351,867.20
应交税费	-	-	-	-	-	1,386,000.00	1,386,000.00
其他负债	-	-	-	-	-	397,729.49	397,729.49
负债总计	-	-	-	-	-	3,665,605.66	3,665,605.66
利率敏感度 缺口	14,533,914.61	-	50,120,000.00	-	-	195,444,432.93	260,098,347.54
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1- 3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,094,373.97	-	-	-	-	-	19,094,373.97
结算备付金	496,853.45	-	-	-	-	-	496,853.45
存出保证金	256,656.18	-	-	-	-	-	256,656.18
交易性金融 资产	-	-	49,604,000.00	-	-	165,724,345.29	215,328,345.29
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	37,632,828.63	37,632,828.63
应收利息	-	-	-	-	-	615,681.45	615,681.45
应收申购款	994.04	-	-	-	-	28,201.99	29,196.03
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	19,848,877.64	-49,604,000.00	-	-204,001,057.36	273,453,935.00
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,516,470.63	4,516,470.63
应付赎回款	-	-	-	141,336.49	141,336.49
应付管理人报酬	-	-	-	340,631.56	340,631.56
应付托管费	-	-	-	56,771.92	56,771.92
应付交易费用	-	-	-	309,789.22	309,789.22
应交税费	-	-	-	1,386,000.00	1,386,000.00
其他负债	-	-	-	397,485.59	397,485.59
负债总计	-	-	-	7,148,485.41	7,148,485.41
利率敏感度缺口	19,848,877.64	-49,604,000.00	-	-196,852,571.95	266,305,449.59

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	+25 个基准点	-38,166.09	-79,092.39
	-25 个基准点	38,166.09	79,092.39

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	197,820,993.78	76.06	165,724,345.29	62.23
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	50,120,000.00	19.27	49,604,000.00	18.63
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	247,940,993.78	95.33	215,328,345.29	80.86

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	+5%	20,680,545.04	20,217,509.69
	-5%	-20,680,545.04	-20,217,509.69

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

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 197,820,993.78 元，属于第二层次的余额为人民币 50,120,000.00 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 165,724,345.29 元，第二层次人民币 49,604,000.00 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

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

7.4.14.4 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	197,820,993.78	75.00
	其中：股票	197,820,993.78	75.00
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	50,120,000.00	19.00
	其中：债券	50,120,000.00	19.00
	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	14,394,835.82	5.46
8	其他各项资产	1,428,123.60	0.54
9	合计	263,763,953.20	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,816,880.00	2.62
B	采矿业	—	—
C	制造业	132,165,646.01	50.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	560,748.00	0.22
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,334,412.37	9.74
J	金融业	19,958,572.40	7.67
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,982,687.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	702,972.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	10,299,076.00	3.96
S	综合	—	—
	合计	197,820,993.78	76.06

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600271	航天信息	810,939	18,562,393.71	7.14
2	002415	海康威视	691,721	17,818,732.96	6.85
3	002410	广联达	843,077	17,544,432.37	6.75
4	600519	贵州茅台	28,784	16,982,847.84	6.53
5	000333	美的集团	401,206	14,788,453.16	5.69
6	601318	中国平安	216,344	12,136,898.40	4.67
7	000651	格力电器	283,846	10,130,463.74	3.89
8	600031	三一重工	983,801	8,204,900.34	3.15
9	000681	视觉中国	341,300	7,959,116.00	3.06
10	300059	东方财富	643,800	7,789,980.00	3.00
11	000998	隆平高科	460,600	6,816,880.00	2.62
12	600036	招商银行	263,000	6,627,600.00	2.55
13	000661	长春高新	37,472	6,557,600.00	2.52
14	002841	视源股份	106,660	6,068,954.00	2.33
15	600436	片仔癀	61,000	5,285,650.00	2.03
16	002304	洋河股份	50,377	4,771,709.44	1.83
17	002236	大华股份	408,587	4,682,407.02	1.80
18	000538	云南白药	53,300	3,942,068.00	1.52
19	002672	东江环保	327,195	3,743,110.80	1.44
20	603288	海天味业	52,254	3,595,075.20	1.38
21	300122	智飞生物	91,700	3,554,292.00	1.37
22	603833	欧派家居	43,615	3,476,987.80	1.34
23	300144	宋城演艺	109,600	2,339,960.00	0.90
24	601888	中国国旅	32,935	1,982,687.00	0.76

25	000001	平安银行	127,300	1,194,074.00	0.46
26	000888	峨眉山 A	124,200	702,972.00	0.27
27	601800	中国交建	49,800	560,748.00	0.22

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000681	视觉中国	41,150,948.63	15.45
2	600588	用友网络	38,098,894.10	14.31
3	600271	航天信息	37,581,988.91	14.11
4	600036	招商银行	31,481,609.75	11.82
5	000651	格力电器	30,751,031.08	11.55
6	002410	广联达	29,321,073.16	11.01
7	601318	中国平安	27,584,194.88	10.36
8	600519	贵州茅台	25,473,946.42	9.57
9	000333	美的集团	25,106,106.07	9.43
10	000661	长春高新	24,548,841.82	9.22
11	603833	欧派家居	23,722,811.91	8.91
12	601939	建设银行	23,058,667.00	8.66
13	300059	东方财富	21,755,377.86	8.17
14	600690	青岛海尔	21,420,263.65	8.04
15	000568	泸州老窖	20,153,009.94	7.57
16	002841	视源股份	20,151,885.50	7.57
17	002415	海康威视	19,317,738.44	7.25
18	601601	中国太保	18,329,426.58	6.88
19	300616	尚品宅配	15,468,527.46	5.81
20	002672	东江环保	13,344,385.00	5.01
21	600030	中信证券	12,377,635.00	4.65
22	000858	五粮液	12,366,997.10	4.64
23	002812	创新股份	12,211,926.04	4.59
24	002352	顺丰控股	12,052,025.48	4.53
25	300357	我武生物	10,857,958.80	4.08
26	002236	大华股份	10,819,452.95	4.06
27	300251	光线传媒	9,934,342.23	3.73

28	002572	索菲亚	8,934,344.45	3.35
29	002376	新北洋	8,639,109.64	3.24
30	600487	亨通光电	8,636,660.00	3.24
31	002304	洋河股份	8,386,518.50	3.15
32	002508	老板电器	8,142,584.33	3.06
33	600115	东方航空	8,106,695.00	3.04
34	300122	智飞生物	7,886,693.97	2.96
35	000063	中兴通讯	7,799,807.00	2.93
36	000895	双汇发展	7,656,404.00	2.88
37	000977	浪潮信息	7,432,086.05	2.79
38	000998	隆平高科	6,744,998.00	2.53
39	002372	伟星新材	6,499,609.20	2.44
40	600028	中国石化	5,453,910.00	2.05
41	601888	中国国旅	5,432,453.39	2.04
42	600436	片仔癀	5,408,977.95	2.03

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600588	用友网络	39,634,927.53	14.88
2	000681	视觉中国	34,135,226.09	12.82
3	002410	广联达	33,925,363.88	12.74
4	000651	格力电器	28,124,042.85	10.56
5	601601	中国太保	26,501,651.48	9.95
6	600036	招商银行	24,577,458.94	9.23
7	603833	欧派家居	24,369,021.94	9.15
8	601318	中国平安	23,562,838.55	8.85
9	600690	青岛海尔	21,997,859.92	8.26
10	000661	长春高新	21,780,497.51	8.18
11	601939	建设银行	21,180,612.70	7.95
12	002236	大华股份	20,843,209.66	7.83
13	000568	泸州老窖	20,536,354.52	7.71
14	600271	航天信息	18,275,264.40	6.86
15	002572	索菲亚	16,034,179.00	6.02
16	300616	尚品宅配	14,784,966.70	5.55
17	002027	分众传媒	14,055,402.31	5.28

18	002841	视源股份	13,971,019.07	5.25
19	000858	五粮液	12,912,346.05	4.85
20	002812	创新股份	12,204,966.40	4.58
21	600030	中信证券	11,934,484.44	4.48
22	300059	东方财富	11,841,428.15	4.45
23	300251	光线传媒	10,753,934.80	4.04
24	600887	伊利股份	10,604,851.05	3.98
25	300357	我武生物	10,593,482.50	3.98
26	002352	顺丰控股	9,987,473.76	3.75
27	600276	恒瑞医药	9,199,175.24	3.45
28	002376	新北洋	9,189,236.94	3.45
29	000063	中兴通讯	9,013,008.81	3.38
30	600487	亨通光电	8,558,967.00	3.21
31	600115	东方航空	8,294,566.96	3.11
32	000977	浪潮信息	7,720,606.22	2.90
33	000895	双汇发展	7,366,152.41	2.77
34	002439	启明星辰	7,044,920.03	2.65
35	002672	东江环保	6,703,714.05	2.52
36	002508	老板电器	6,571,618.18	2.47
37	600196	复星医药	6,301,879.78	2.37
38	600519	贵州茅台	5,655,348.80	2.12
39	002384	东山精密	5,351,219.59	2.01

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	868,179,556.81
卖出股票收入（成交）总额	785,347,213.43

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	50,120,000.00	19.27
	其中：政策性金融债	50,120,000.00	19.27
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	50,120,000.00	19.27

8.6 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

金额单位：人民币元

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	180207	18 国开 07	500,000	50,120,000.00	19.27

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	139,078.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	1,270,256.23
5	应收申购款	18,788.58
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,428,123.60

8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明。

8.12.6 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。

§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

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,955	23,978.45	31,899,441.18	22.34%	110,892,199.94	77.66%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	15,560.84	0.01%

9.3 期末基金管理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，本基金管理人高级管理人员、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本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2009 年 4 月 27 日 ）基金份额总额	2,672,979,485.72
本报告期期初基金份额总额	120,409,689.62
本报告期期间基金总申购份额	41,002,098.21
减:本报告期期间基金总赎回份额	18,620,146.71
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	142,791,641.12

注：本期申购中包含转入份额，本期赎回中包含转出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 6 月 23 日发布关于副总经理任职的公告，经本基金管理人董事会审议通过，苏薪茗先生自 2018 年 6 月 21 日起担任本基金管理人副总经理职务。

11.2.2 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，本基金托管人未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未变更为其审计的会计师事务所，报告期内本基金应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬共计人民币 50,000 元。该审计机构已为本基金连续提供了 10 年的服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
瑞银证券有 限责任公司	1	327,727,583.25	19.81%	305,211.96	21.72%	—
中泰证券股 份有限公司	3	239,732,289.25	14.49%	223,262.55	15.89%	—
东吴证券股 份有限公司	2	213,436,767.45	12.90%	156,086.28	11.11%	—
东北证券股 份有限公司	2	212,026,271.40	12.82%	155,054.24	11.04%	—
方正证券股 份有限公司	2	185,439,242.55	11.21%	172,699.89	12.29%	—
国盛证券有 限责任公司	2	89,293,638.81	5.40%	65,299.30	4.65%	新增 2 个 交易单元
长江证券股 份有限公司	2	73,022,157.90	4.41%	53,401.30	3.80%	—
国泰君安证 券股份有限 公司	1	50,808,454.23	3.07%	47,318.33	3.37%	—
招商证券股 份有限公司	1	50,348,935.89	3.04%	46,890.45	3.34%	—
安信证券股 份有限公司	2	38,301,380.67	2.32%	28,009.68	1.99%	—
国海证券股 份有限公司	2	37,280,195.12	2.25%	34,719.36	2.47%	—
西藏东方财 富证券	2	32,837,582.31	1.99%	30,581.64	2.18%	—
华泰证券股	2	28,901,706.46	1.75%	21,135.61	1.50%	—

份有限公司						
浙商证券股 份有限公司	2	22,727,589.78	1.37%	16,620.68	1.18%	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	16,414,377.14	0.99%	15,286.92	1.09%	-
西部证券股 份有限公司	2	16,104,461.60	0.97%	14,998.03	1.07%	-
英大证券有 限责任公司	1	12,537,096.63	0.76%	11,675.65	0.83%	-
兴业证券股 份有限公司	1	6,587,039.80	0.40%	6,134.46	0.44%	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
爱建证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个 交易单元
中国国际金 融有限公司	2	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个 交易单元
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
厦门证券有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交易单元

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准与被选择的证券经营机构签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	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
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股	-	-	-	-	-	-

份有限公司						
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
爱建证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏同信证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
厦门证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司 2017 年 12 月 31 日基金净值公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 2 日
2	《银华基金管理股份有限公司关于证券投资基金执行增值税政策的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 3 日
3	《关于网上直销开通中国建设银行快捷支付业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 3 日
4	《银华基金管理股份有限公司关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 10 日
5	《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 1 月 19 日
6	《银华基金管理股份有限公司关于参加大泰金石基金销售有限公司和北京展恒基金销售有限公司费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 2 月 8 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 3 月 9 日
8	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分公开募集开放式证券投资基金赎回费的提示性公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 3 月 27 日

9	《银华和谐主题灵活配置混合型 证券投资基金托管协议 (2018 年 3 月修订)》	本基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
10	《银华和谐主题灵活配置混合型 证券投资基金基金合同 (2018 年 3 月修订)》	本基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
11	《银华基金管理股份有限公司关 于修订公司旗下部分基金基金合 同有关条款及调整赎回费的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
12	《银华基金管理股份有限公司关 于在交通银行参加手机银行渠道 费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 30 日
13	《银华基金管理股份有限公司关 于旗下部分基金参加中国工商银 行个人电子银行基金申购费率优 惠活动的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 30 日
14	《银华和谐主题灵活配置混合型 证券投资基金 2017 年年度报告 摘要》	三大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 3 月 30 日
15	《银华和谐主题灵活配置混合型 证券投资基金 2017 年年度报告》	本基金管理人网站	2018 年 3 月 30 日
16	《银华和谐主题灵活配置混合型 证券投资基金 2018 年第 1 季度 报告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 4 月 23 日
17	《银华基金管理股份有限公司关 于旗下部分基金参加中国国际金 融股份有限公司费率优惠活动的	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 4 月 24 日

	公告》		
18	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 4 月 24 日
19	《关于网上直销开通中国农业银行快捷支付业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 5 月 3 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司参加其申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 5 月 12 日
21	《关于旗下部分基金在中国银河证券股份有限公司开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 5 月 18 日
22	《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2018 年第 1 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 11 日
23	《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2018 年第 1 号）》	本基金管理人网站	2018 年 6 月 11 日
24	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金定期定额投资的最低金额的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 11 日
25	《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行股份有限公司定期定额投资业务起点的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 13 日

26	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的天齐锂业、永清环保、楚江新材估值方法调整的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
27	《银华基金管理股份有限公司关于暂停及恢复网上交易相关业务的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 23 日
28	《银华基金管理股份有限公司关于开通超级生利宝赎回转购业务并实施费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 23 日
29	《银华基金管理股份有限公司关于增加北京格上富信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 29 日
30	《银华基金管理股份有限公司关于在中泰证券开通旗下部分基金定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 29 日
31	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行参加手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 6 月 30 日
32	《银华基金管理股份有限公司 2018 年 6 月 30 日基金净值公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 7 月 2 日
33	《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 7 月 19 日
34	《银华基金管理股份有限公司关于增加中民财富基金销售（上海）	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 7 月 23 日

	有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》		
35	《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 8 月 28 日
36	《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告》	本基金管理人网站	2018 年 8 月 28 日
37	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金持有的美的集团估值方法调整的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 9 月 22 日
38	《银华基金管理股份有限公司关于在交通银行参加手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 9 月 29 日
39	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加北京创金启富投资管理有限公司费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 23 日
40	《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 3 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 24 日
41	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加众升财富（北京）基金销售有限公司费率优惠的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2018 年 10 月 27 日
42	《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要（2018 年第 2 号）》	三大证券报及本基金管理人网站	2018 年 12 月 10 日

43	《银华和谐主题灵活配置混合型 证券投资基金更新招募说明书 (2018 年第 2 号)》	本基金管理人网站	2018 年 12 月 10 日
44	《银华基金管理股份有限公司关 于增加阳光人寿保险股份有限公 司为旗下部分基金代销机构的公 告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 12 月 14 日
45	《银华基金管理股份有限公司关 于银华和谐主题灵活配置混合型 证券投资基金基金经理离任的公 告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2018 年 12 月 29 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2018 年 3 月 28 日披露了《关于修订公司旗下部分基金基金合同有关条款及调整赎回费的公告》，修订后的《基金合同》自本公告发布之日起生效，但为不影响原有基金份额持有人的利益，《基金合同》中“本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产”的条款将于 2018 年 4 月 1 日起正式实施。

2、本基金管理人于 2018 年 6 月 11 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金定期定额投资的最低金额的公告》，自 2018 年 6 月 12 日起调整本基金定期定额投资的最低金额为 10 元。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会核准银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 13.1.2 《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 13.1.3 《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 13.1.4 《银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 13.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 13.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
- 13.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
- 13.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 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办公场所。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。

13.3 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

2019 年 3 月 28 日