

(上接B109版)

4.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金份额持有人的利益。
十三 投资组合报告
本基金管理人的董事会及监事会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。
本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2018年11月23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。
本报告投资组合所载数据截至2018年9月30日,本报告所列财务数据未经审计。
(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	161,287,617.78	61.90
	其中:股票	161,287,617.78	61.90
2	固定收益投资	36,323.10	0.01
	其中:债券	36,323.10	0.01
	资产支持证券	--	--
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	96,588,058.22	37.05
7	其他金融资产	2,692,838.57	1.03
8	合计	260,704,837.47	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1.报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧、渔业	--	--
B	制造业	--	--
C	矿业	--	--
D	电力、热力、燃气及生产供应业	88,259,850.91	33.96
E	建筑业	2,748,263.80	1.06
F	批发零售业	108,232.20	0.04
G	信息技术业	9,750,153.00	3.75
H	交通运输、仓储和邮政业	3,826,573.22	1.47
I	住宿和餐饮业	--	--
J	金融业	5,685,179.96	2.14
K	房地产业	16,625,615.86	6.40
L	医药制造业	12,227,800.80	4.71
M	科学研究和技术服务业	6,471,004.00	2.49
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	卫生和社会工作	--	--
P	教育、文化和体育业	--	--
Q	新闻、出版和传媒业	5,290,962.75	2.04
R	综合	10,472,770.00	4.03
S	合计	161,287,617.78	62.10

2.报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农林、牧、渔业	--	--
B	制造业	--	--
C	矿业	--	--
D	电力、热力、燃气及生产供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发零售业	--	--
G	信息技术业	--	--
H	交通运输、仓储和邮政业	--	--
I	住宿和餐饮业	--	--
J	金融业	--	--
K	房地产业	--	--
L	医药制造业	--	--
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	卫生和社会工作	--	--
P	教育、文化和体育业	--	--
Q	新闻、出版和传媒业	--	--
R	综合	--	--
S	合计	--	--

本基金本报告期末未持有港股投资股票。

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600271	航天信息	286,762	7,980,586.46	3.07
2	600036	招商银行	233,600	7,169,184.00	2.76
3	601933	永辉超市	861,600	7,022,040.00	2.70
4	600048	保利地产	573,200	6,975,844.00	2.68
5	300144	瑞丰新材	308,200	6,837,450.00	2.64
6	000661	长春高新	28,159	6,673,683.00	2.57
7	002027	雪人机械	766,400	6,471,204.00	2.49
8	601318	中国平安	89,500	6,139,750.00	2.36
9	000860	顺鑫农业	139,400	5,946,240.00	2.29
10	603345	安存生物	144,223	5,742,999.86	2.21

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
	其中:政策性金融债	--	--
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)	36,323.10	0.01
8	其他债券	--	--
9	合计	36,323.10	0.01

(五)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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111813	财开转债	330	36,323.10	0.01

(六)报告期末公允价值低于净资产比例大小排序的前十名资产支持证券投资组合

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

(八)报告期末未持有贵金属

(九)报告期末公允价值低于净资产比例大小排序的前五名权证投资明细

(十)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与股指期货投资。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货,无相关投资政策。

(十一)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货交易政策

本基金报告期内未参与国债期货交易。

10.2报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金报告期内未参与国债期货交易。

10.3本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货交易,无相关投资评价。

(十二)投资组合报告附注

11.1.本报告编制日前一年内,招商基金(以下简称“招商基金”)因涉嫌违反法律法规,被深圳证监局、中国证监会处以

罚款,没收违法所得。

基金管理人通过进一步了解了,认为该处罚不会对相关证券的投资价值和成本实质性影响。基金管理人通过进一步了解了,认为该处罚不会对相关证券的投资价值和成本实质性影响。基金管理人通过进一步了解了,认为该处罚不会对相关证券的投资价值和成本实质性影响。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余的发行主体本期没有出现过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、处罚的情况。
11.2.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范围。
11.3. 其他资产组合情况

序号	名称	金额(元)
1	应收股利	171,282.06
2	应收证券清算款	2,454,067.80
3	应收利息	--
4	应收利息	--
5	应收申购款	17,171.36
6	其他应收款	49,666.61
7	预收款项	--
8	其他	--
9	合计	2,692,838.57

11.4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.6.投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十四 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2009年4月3日,基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准增长率	业绩比较基准增长率标准差	①-③	②-④
2009年4月3日至2009年12月31日	23.38%	1.15%	25.59%	1.29%	-2.15%	-0.13%
2010年1月1日至2010年12月31日	4.36%	1.14%	-6.78%	1.03%	11.14%	0.11%
2011年1月1日至2011年12月31日	-16.12%	0.97%	-15.40%	0.85%	-0.72%	0.12%
2012年1月1日至2012年12月31日	5.22%	1.09%	6.51%	0.83%	-1.29%	0.26%
2013年1月1日至2013年12月31日	17.41%	1.25%	-4.21%	0.91%	21.62%	0.34%
2014年1月1日至2014年12月31日	30.09%	1.59%	34.33%	0.79%	-4.24%	0.36%
2015年1月1日至2015年12月31日	49.09%	2.42%	6.94%	1.62%	42.15%	0.80%
2016年1月1日至2016年12月31日	-21.51%	1.56%	-6.15%	0.91%	-15.36%	0.65%
2017年1月1日至2017年12月31日	28.84%	0.94%	13.06%	0.42%	15.78%	0.52%
2018年1月1日至2018年12月31日	-12.96%	1.35%	-8.64%	0.79%	-4.32%	0.56%
自基金合同生效日至2018年12月31日	127.75%	1.37%	40.57%	0.98%	87.18%	0.39%

十五 基金的费用概览

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。
一、本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。
二、根据基金份额的分类与净值计算规则,本基金优先满足转债A级份额的本金及累计约定应得收益,后将剩余净资产计为转债B级份额的净资产。基金管理人并不承诺或保证转债A级份额的基金份额持有人的本金安全和约定应得收益。
三、本基金中转债800A份额具有高风险、高预期收益的特征。如本基金发生净值下跌,转债800B份额的杠杆倍数将由目前的约4倍降低为初始的2倍,相应地,转债800B份额的份额净值随每基金份额净值涨跌而增长或者下降的幅度也会减小。
四、按照基金合同的约定,当某交易日转债800B份额的基金份额净值达到0.250元及以下时,触发转债800B份额的赎回,由于触发折算净值当日,转债800B份额的参考净值可能已低于阈值,而折算基准日在触发阈值日后才能确定,折算基准日当日的市场波动将可能造或转债800B份额的净值下跌,从而导致折算基准日的转债800B份额净值与折算触发日转债800B份额净值以及折算阈值0.250元均存在一定的差异。
五、本基金中转债800A份额具有高风险、预期收益相对稳定的特征,但在下阈值不定期份额折算发生后,原转债800A份额持有人所持持有基金份额的风险收益特征将发生变化,由原来的单一的低风险收益特征转债800A份额,变为同时包括低风险收益特征转债800A份额与较高风险收益特征转债800B级份额,因此原转债800A份额持有人的预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

- 根据深圳证券交易所的相关业务规则,转债800A份额、转债800B份额、800分级别份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金财产。因此,基金份额持有人面临由于折算后份额数取整计算而导致相应的不足1份的资产被强制归入基金财产的风险。
- 为保证本基金在折算期间的平稳运作,本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关业务规定,暂停转债800A份额与转债800B份额的上市交易,暂停800分级别份额的申购及赎回等相关业务,届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资人予以关注。
- 投资者若希望了解本基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金的基金合同及《银华中证800等权重增强分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)或者拨打本基金管理人客服电话:400-678-3333(免长途话费)。
- 本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。
- 本基金管理人提醒投资人知晓基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担,市场有风险,投资须谨慎。敬请投资人于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律法规文件。

特此公告。
银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金可能发

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金之中证800B交易价格波动提示公告

近期,银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金(以下简称“本基金管理人”)旗下银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金之“中证800B”份额(简称“转债800B”份额,场内简称:转债800B,基金代码:150139)二级市场交易价格连续波动,截至2018年12月5日,转债800B份额二级市场收盘价为0.488元,相对于当日的基金份额参考净值0.397元,溢价幅度达到22.92%,明显高于基金份额参考净值,投资者如果盲目投资,可能遭受重大损失。

为此,本基金管理人提示如下:
1. 转债800B份额具有高风险、高预期收益的特征。由于转债800B份额内含杠杆机制的设计,转债800B份额参考净值的波动幅度将大于银华中证800B份额(场内简称:800分级,基金代码:161825)和转债800A份额(稳健收益类份额,场内简称:转债800A,基金代码:150138)基金份额参考净值的波动幅度,即转债800B的波动性要高于其他两类份额,其风险也更高。转债800B份额的持有人会因杠杆机制的放大而承担不同程度的投资风险。

2. 转债800B份额的交易价格,除了受基金份额参考净值影响外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资人面临损失。
3. 截至2018年12月06日收盘,转债800B份额二级市场收盘价为0.440元,转债800B份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算下阈值。下阈值不定期份额折算后,转债800B份额的溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场的投资者注意溢价率变化带来的风险。

4. 截至本公告披露日,银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金合同和招募说明书等相关法律法规及基金合同进行投资运作。
5. 截至本公告披露日,银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金合同和招募说明书等相关法律法规及基金合同进行投资运作。
6. 本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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应仔细阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律法规文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。
银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金可能发

关于银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期

截止2018年12月5日,汇邦科技持有公司股份370,449,804股,占公司总股本的比例为18.21%,其所持有公司股份被质押的数量总数为203,849,800股, 占其所持公司股份总数的55.03%, 占公司总股本的比例为10.02%。

四、备查文件

- 安徽国元信托有限责任公司股票质押合同;
- 国泰君安证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议书;
- 西南证券股份有限公司西南证券股票质押式回购交易协议书;
- 解除证券质押登记通知、交割单。

特此公告。
华邦生命健康股份有限公司
董事会
2018年12月07日

关于银华中证转债指数增强分级证券投资基金可能发不定期份额折算的风险提示公告

根据《银华中证转债指数增强分级证券投资基金基金合同》(以下简称“