银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

(原银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金)

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(“本基金合同”)、《银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金基金合同》的规定,于2016年7月15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。

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。

本基金管理人于2016年3月28日15:00起至2016年4月15日17:00止,期间以通讯方式召开了银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金转型有关事项的议案》,本基金管理人于 2016 年 4 月 25日发布了《关于银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金份额持有人大会决议生效的公告》。

根据生效的基金份额持有人大会决议,自2016年4月25日起《银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金基金合同》失效且《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,同时基金更名为“银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金”,基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》相关约定为准。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月25日(基金合同生效日)起至2016年6月30日止(注:银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金报告期为自2016年4月1日起至2016年4月24日(《银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金基金合同》失效前日)止)。

§2 基金产品概况

[illegible]

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	28,976.00	0.23
B	采矿业	35,761.00	0.28
C	制造业	1,888,321.58	14.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,549.00	0.14
E	建筑业	99,610.96	0.77
F	批发和零售业	72,114.79	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	16,740.96	0.13
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	778,435.00	6.05
J	金融业	149,666.00	1.16
K	房地产业	46,434.99	0.36
L	租赁和商务服务业	55,274.63	0.43
M	科学研究和技术服务业	24,760.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	31,551.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	74,775.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	148,459.00	1.15
S	综合	11,384.00	0.09
	合计	3,481,013.31	27.05

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末不持有沪港通投资股票。
5.3 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	000728	国元证券	4,400	73,568.00	0.57
2	300017	网宿科技	600	40,320.00	0.31
3	300104	乐视网	700	37,037.00	0.29
4	300431	暴风集团	500	36,250.00	0.28
5	300059	东方财富	1,400	31,080.00	0.24
6	601989	中国重工	4,900	31,017.00	0.24
7	300182	捷成股份	1,800	30,798.00	0.24
8	300253	卫宁健康	1,200	29,640.00	0.23
9	300147	香雪制药	2,000	29,460.00	0.23
10	300498	温氏股份	800	28,976.00	0.23

5.4 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	国家债券	1,519,050.00	11.80
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)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	1,519,050.00	11.80

5.5 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	019504	15国债04	15,000	1,519,050.00	11.80

注:本基金本报告期末不持有资产支持证券。
5.6 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资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末不持有资产支持证券。
5.7 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:本基金本报告期末不持有贵金属。
5.8 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权证投资明细
注:本基金本报告期末不持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末不持有股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末不持有国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
5.11.2 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库之外的情形。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,969.27
2	应收证券清算款	7,001,477.78
3	应收股利	–
4	应收利息	13,955.19
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,018,402.24

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000728	国元证券	73,568.00	0.57	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,比例的分项之和与合计可能有尾差。

转型后:

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,204,597.95	20.29
	其中:股票	3,204,597.95	20.29
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	11,806,350.00	74.77
	其中:债券	11,806,350.00	74.77
	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	628,103.38	3.98
8	其他资产	151,386.69	0.96
9	合计	15,790,438.22	100.00

注:由于四舍五入的原因,市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	40,066.56	0.29
B	采矿业	90,906.58	0.65
C	制造业	2,013,629.52	14.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	86,816.81	0.62
E	建筑业	74,759.26	0.54
F	批发和零售业	167,226.15	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	111,348.74	0.80
H	住宿和餐饮业	5,626.24	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	154,938.85	1.11
J	金融业	29,837.16	0.21
K	房地产业	207,785.44	1.49
L	租赁和商务服务业	43,879.92	0.31
M	科学研究和技术服务业	25,294.73	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	30,978.42	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	25,353.40	0.18
R	文化、体育和娱乐业	38,131.70	0.27
S	综合	58,018.27	0.42
	合计	3,204,597.95	22.95

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末不持有沪港通投资股票。
5.3 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	600201	生物股份	1,686	51,321.84	0.37
2	300072	三聚环保	1,689	43,052.61	0.31
3	600521	华海药业	1,341	36,837.27	0.26
4	601012	隆基股份	2,979	36,343.80	0.26
5	600376	首开股份	3,185	33,219.55	0.24
6	000661	长春高新	287	29,618.40	0.21
7	600881	亚泰集团	5,126	29,013.16	0.21
8	002018	华信国际	2,242	27,890.48	0.20
9	600879	航天电子	1,773	27,126.90	0.19
10	002311	海大集团	1,715	26,925.50	0.19

5.4 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	国家债券	8,540,650.00	61.22
2	央行票据	–	–
3	金融债券	3,257,700.00	23.33
	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)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	11,806,350.00	84.55

5.5 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	019518	15国债18	55,000	5,499,450.00	39.38
2	018002	国开1302	30,000	3,257,700.00	23.33
3	019504	15国债04	30,000	3,049,200.00	21.84

注:本基金2016年4月24日以内持有上述三只债券。
5.6 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。
5.7 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。
5.8 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
5.9 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。
5.10 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
5.11.2 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库之外的情形。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	230.85
2	应收证券清算款	3,928.48
3	应收股利	–
4	应收利息	147,227.36
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	151,386.69

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金2016年4月24日以内持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000661	长春高新	29,618.40	0.21	重大事项
2	600879	航天电子	27,126.90	0.19	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	中证90A	中证90B	90分级
报告期期初基金份额总额	36,423,902.00	36,423,902.00	200,254,102.45
报告期期间基金总申购份额	–	–	1,789,378.03
减:报告期期间基金总赎回份额	–	–	13,763,807.68
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	–3,264,354.00	–3,264,354.00	6,528,708.00
报告期期末基金份额总额	33,159,548.00	33,159,548.00	194,808,380.80

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资本基金情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
9.1.1 中国证监会核准银华中证等权重90指数分级证券投资基金募集的文件
9.1.2《银华中证等权重90指数分级证券投资基金招募说明书》
9.1.3《银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金合同》
9.1.4《银华中证等权重90指数分级证券投资基金托管协议》
9.1.5《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照
9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照
9.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告
9.2 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。
9.3 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。

银华基金管理有限公司
2016年7月19日

银华中证等权重90指数分级证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:银华基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	银华中证等权重90指数分级
场内简称	90分级
交易代码	161816
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月17日
报告期末基金份额总额	261,127,476.80份
投资目标	本基金力争对中证等权重90指数进行有效跟踪,并力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以分享中国经济的持续、稳定增长成果,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在中证等权重90指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以期合.跟踪中证等权重90指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整、或份额发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回过本基金跟踪中证等权重90指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,力争跟踪误差控制在规定的范围之内。 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于中证等权重90 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;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。
业绩比较基准	95%×中证等权重90指数收益率+5%×商业银行人民币活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,从本基金所分离的两类基金份额来看,中证90A份额具有低风险、收益相对稳定的特征;中证90B份额具有高风险、高预期收益的特征。
基金管理人	银华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金简称	中证90A / 中证90B / 90分级
下属分级基金交易代码	150030 / 150031 / 161816
下属分级基金报告期末基金份额总额	33,159,548.00份 / 33,159,548.00份 / 194,808,380.80份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。 / 高风险、高预期收益。 / 较高风险、较高预期收益。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 — 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	−6,381,186.76
2.本期利润	−4,104,424.93
3.加权平均基金份额本期利润	−0.0155
4.期末基金资产净值	261,618,342.97
5.期末基金份额净值	1.002

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、上述本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 本报告期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	净值增长率①	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
2016年4月1日至2016年4月24日	−0.86%	0.40%	−1.00%	0.46%	0.14%	−0.06%

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

按基金合同的规定,本基金(转型前)自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到基金合同的规定:本基金投资于债券等固定收益类金融工具的投资比例合计不低于基金资产的80%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周大鹏先生	本基金的基金经理	2013年5月22日	2016年4月25日	7年	硕士学位,毕业于中国人民大学,2008年7月加盟银华基金管理有限公司,曾担任银华基金管理有限公司量化投资部研究员及基金经理助理职务,自2011年9月20日起至2014年1月6日期间担任银华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,自2014年1月7日起兼任银华沪深300指数分级证券投资基金(由银华沪深300指数证券投资基金(LOF)转型)基金经理,自2012年8月23日起兼任上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理,自2012年8月29日起兼任银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,自2016年1月14日起兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理,具有从业资格,国籍:中国。
葛鹤军先生	本基金的基金经理	2014年10月8日	2016年4月25日	6年	博士学位,2008年至2011年就职于中诚信证券评估有限公司,中诚信国际信用评级有限公司,2011年11月加盟银华基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,2014年10月8日起兼任银华中证中期50指数债券型证券投资基金(LOF),银华信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理,自2015年5月6日起兼任银华恒利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2015年6月17日起兼任银华信用双利债券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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张凯先生	本基金的基金经理	2016年4月25日	–	6年	硕士学位,毕业于清华大学,2009年7月加盟银华基金管理有限公司,曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务,自2012年11月14日起兼任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理,自2013年11月5日起兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理,自2016年1月14日起兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理,自2016年4月7日起兼任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基金经理,自2016年4月25日兼任银华量化智慧动力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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张凯先生	本基金的基金经理	2012年11月14日	–	6.5年	硕士学位,毕业于清华大学,2009年7月加盟银华基金管理有限公司,曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务,自2013年11月5日起兼任银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金基金经理,自2016年1月14日起兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理,自2016年4月7日起兼任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基金经理,自2016年4月25日兼任银华量化智慧动力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之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》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《银华基金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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人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》,制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等,并建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节,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。同时,在投资决策过程中,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投资交易情况进行分析,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。

综上所述,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。

4.3.2 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,本基金交易所有投资组合不存在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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内,我们运用自行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。尽管报告期间本基金多次发生大额申购赎回,我们仍将跟踪误差控制在合理水平。

过去的一个季度,A股市场在一系列内部和外部事件的冲击下,出现较大的震荡。在季度初随着权威人士讲话对大幅度经济刺激的否定及一系列金融经济数据回落的背景下,投资者对国内全面进入货币宽松的高预期落空,一季度反弹行情也宣告结束;随后A股是否纳入MSCI指数、人民币贬值预期、英国退欧等一系列事件,都对投票市场的走势短期产生了较大的影响。但在多种偏负面的因素影响下,A股市场逐渐止住跌势、顽强上行,表现颇为强势。

展望下半年,随着英国退欧的短期负面影响逐步被投资者消化甚至淡忘,人民币汇率在央行的强势干预下稳定有序的区间波动,叠加上即将到来的一段宏观经济和公司财报数据的真空蜜月期,A股市场有望在三季度有较为强势的表现。

本基金将继续坚持既定的指数化投资策略,以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为主要投资目标,期望本基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.002元,本报告期份额净值增长率为−1.47%,同期业绩比较基准收益率为−2.49%。报告期内,本基金日均跟踪误差控制在0.35%之内,年化跟踪误差控制在4%之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	243,457,038.66	92.75
	其中:股票	243,457,038.66	92.75
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	18,020,786.06	6.87
8	其他资产	1,017,874.59	0.39
9	合计	262,495,699.31	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	8,004,534.36	3.06
C	制造业	81,002,180.97	30.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,345,005.49	2.04
E	建筑业	13,046,971.98	4.99
F	批发和零售业	2,662,198.68	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	7,917,599.04	3.03
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,332,510.04	5.86
J	金融业	85,734,762.58	32.77
K	房地产业	11,397,412.75	4.36
L	租赁和商务服务业	2,825,336.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	2,606,329.60	1.00
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	5,067,871.76	1.94
S	综合	–	–
	合计	240,942,713.25	92.10

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采掘业	2,514,325.41	0.96
C	制造业	–	–
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
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	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
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	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	–	–
S	综合	–	–
	合计	2,514,325.41	0.96

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票投资。
5.3 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
5.3.1 报告期末指数投资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	000651	格力电器	157,665	3,479,666.55	1.33
2	000002	万 科A	189,781	3,454,014.20	1.32
3	000783	长江证券	260,409	3,020,744.40	1.15
4	000768	中航飞机	153,179	3,016,094.51	1.15
5	002736	国信证券	174,283	3,006,381.75	1.15
6	002230	科大讯飞	91,169	2,994,901.65	1.14
7	600519	贵州茅台	9,996	2,918,032.32	1.12
8	000858	五 粮 液	88,747	2,886,939.91	1.10
9	600887	伊利股份	172,981	2,883,593.27	1.10
10	002183	怡 亚 通	197,300	2,825,336.00	1.08

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000629	*ST钒钛	1,052,019	2,514,325.41	0.96

注:本基金本报告期末仅持有上述积极投资股票。
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。
5.5 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
注:本基金本报告期末未持有债券。
5.6 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。
5.7 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投资。
5.8 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。
5.9 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。
5.10 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
5.11.2 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库之外的情形。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,194.46
2	应收证券清算款	53,696.55
3	应收股利	–
4	应收利息	37,521,206.64
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	37,597,097.65

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1