

## 银华-道琼斯88精选证券投资基金

## 2018年第二季度报告

基金管理人：银华基金管理股份有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：2018年7月19日

基金管理人的董事会及董事保证本基金报告不存在虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本基金报告不存在虚假记载、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。

本报告中财务数据未经审计。

§ 2 基金产品概况

基金简称 银华-道琼斯88精选证券投资基金

交易代码 180003

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2004年6月11日

报告期末基金资产总额 1,038,221,162.00份

投资目标 本基金运用量化分析的方法识别股票投资机会，通过严格的风险控制和风险管理，力争实现超越业绩基准的收益。

投资策略 本基金为增强型指数基金，通过跟踪中国88指数的基本指数投资组合，同时根据对宏观经济、行业状况、政策环境、市场情绪等的综合判断，进行积极的资产配置，从而在获得指数收益的基础上，获取与指数的平均数更高的超额收益。

业绩比较基准 通过定期调整的股票指数

本基金是属于投资于指数的证券投资基金，即以跟踪股票指数为目标，通过投资于股票指数成分股，以期获得与股票指数相似的收益。

风险特征 本基金是通过被动地跟踪股票指数而获得收益的基金，因此具有与股票指数相同的特性和风险。

基金管理人 银华基金管理股份有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)

1.本期已实现收益 25,130,430.49

-105,639,852.86

-0.0047

2.期末可供分配利润 2,100,500,210.21

3.期末基金净值 100.03

注：1.经本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期，在建仓期结束时本基金的各项投资比例已达本基金的约定；本基金的股票资产投资比例上限为6%，且保持不低于基金资产6%的现金或到期日在一年内的政府债券。

2.上述基金业绩报酬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率将低于列示的净值。

3.基金净值

§ 2.1 本期报告期基金净值增长率及其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

过去三个月 -0.72% 1.02% -0.90% 1.21% 2.63% -0.18%

注：1.本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期，在建仓期结束时本基金的各项投资比例已达本基金的约定；本基金的股票资产投资比例上限为6%，且保持不低于基金资产6%的现金或到期日在一年内的政府债券。

2.上述基金业绩报酬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率将低于列示的净值。

3.基金净值

§ 2.2 本期报告期基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期，在建仓期结束时本基金的各项投资比例已达本基金的约定；本基金的股票资产投资比例上限为6%，且保持不低于基金资产6%的现金或到期日在一年内的政府债券。

4.报告期期末基金资产净值 1,038,221,162.00份

5.报告期期末基金份额总额 2,100,500,210.21份

6.期末基金资产净值 100.03

7.报告期期末可供分配利润 2,100,500,210.21份

8.期末可供分配基金份额净值 100.03

9.报告期期末基金资产净值 1,038,221,162.00份

10.报告期期末基金份额总额 2,100,500,210.21份

11.报告期期末基金资产净值 100.03

12.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

13.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

14.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

15.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

16.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

17.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

18.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

19.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

20.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

21.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

22.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

23.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

24.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

25.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

26.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

27.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

28.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

29.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

30.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

31.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

32.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

33.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

34.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

35.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

36.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

37.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

38.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

39.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

40.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

41.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

42.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

43.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

44.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

45.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

46.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

47.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

48.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

49.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

50.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

51.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

52.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

53.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

54.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

55.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

56.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

57.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

58.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

59.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

60.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

61.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

62.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

63.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

64.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

65.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

66.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

67.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

68.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

69.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

70.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

71.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

72.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

73.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

74.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

75.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

76.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

77.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

78.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

79.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

80.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

81.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

82.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

83.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

84.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

85.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

86.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

87.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

88.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

89.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

90.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

91.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

92.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

93.报告期期末可供分配基金份额总额 2,100,500,210.21份

94.报告期期末可供分配基金份额净值 100.03

95.报告期期末可供分配金额 20,779,489.05份

9