

银华智荟分红收益灵活配置混合型发起式证券投资基金

2018年第二季度报告

仓位方面,基于基金经理对宏观环境和流动性因素的判断,本基金二季度仓位始终维持较高水平。

二季度市场波动很大,内外忧患风险叠加释放导致6月沪深300最大跌幅超过10%,这是继2015年底和2016年两期后的单月最大跌幅,这次大幅调整的核心原因在于国际宏观环境恶化和国内资管新规导致的市场流动性风险的释放,根据来源于国际宏观环境恶化的不确定性更甚,特别是房地产行业在行业比较中,消费行业的增长的确定性更强,特别是房地产行业比较优势非常明显,与此同时,随着市场的大幅调整,目前的估值水平基本达到了历史较佳位置,那些依然有较好成长性的龙头企业具备了更好的投资机会。

45 报告期内基金的投资组合和资产分配情况

截至报告期末,本基金份额净值为0.8639元,本报告期份额净值增长率为-8.14%。

46 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

报告期内,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,出现该情况的时间范围为2018年2月13日至2018年6月30日。由于本基金属于发起式基金,无需向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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	23,081,186.19	87.67
2	固定收益	25,081,186.19	87.67
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,196,728.19	12.14
8	其他资产	46,227.00	0.17
9	合计	26,103,186.19	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)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,823,143.00	7.22
B	制造业	16,239,185.47	64.08
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
D	建筑业	-	-
E	交通运输、仓储业	1,234,234.00	4.87
F	信息、计算机和通信技术服务	3,774,612.72	14.93
G	金融业	-	-
H	房地产业	-	-
I	其他行业	-	-
J	其他行业	-	-
K	其他行业	-	-
L	其他行业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-
U	其他行业	-	-
V	其他行业	-	-
W	其他行业	-	-
X	其他行业	-	-
Y	其他行业	-	-
Z	其他行业	-	-
合计		23,081,186.19	91.00

5.2.2 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。

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

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	600523	华信国际	51,979	1,077,673.68	7.90
2	002270	联发科	117,400	1,048,412.00	7.69
3	000013	深农生物	26,897	1,041,028.80	7.60
4	000013	广生堂	59,354	1,040,107.70	7.60
5	000066	张江高科	52,687	1,417,081.27	10.48
6	002111	海大集团	87,076	1,415,303.00	10.46
7	300038	国脉医药	54,000	1,113,240.00	8.20
8	002532	融捷股份	151,000	1,059,197.60	7.81
9	300523	华信国际	51,979	1,077,673.68	7.90
10	600666	张江高科	26,897	1,040,107.70	7.60

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十名债券投资

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

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

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

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

5.1.1 本基金报告期内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。

5.1.2 本基金报告期内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。

5.1.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	银行存款	27,410.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	276.70
5	应收申购款	80,156.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,273.47

5.1.4 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可转换债券。

5.1.5 报告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的情况。

5.1.6 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

序号	名称	金额(元)
1	期初基金份额	1,126.80
2	申购基金份额	102.44
3	赎回基金份额	-
4	基金份额变动	989,213.66
5	期末基金份额	989,213.66
6	基金份额	989,213.66

注:本基金本报告期末基金份额持有人人数为二百零二人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 7 基金投资组合报告

7.1 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	-	-
2	固定收益	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	619,684.38	1.30
8	其他资产	981,624.38	1.96
9	合计	51,113,824.02	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	制造业	50,728,240.00	98.52
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
D	建筑业	-	-
E	交通运输、仓储业	-	-
F	信息、计算机和通信技术服务	800,000.00	1.53
G	金融业	-	-
H	房地产业	-	-
I	其他行业	-	-
J	其他行业	-	-
K	其他行业	-	-
L	其他行业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-
U	其他行业	-	-
V	其他行业	-	-
W	其他行业	-	-
X	其他行业	-	-
Y	其他行业	-	-
Z	其他行业	-	-
合计		51,113,824.02	100.00

7.2.2 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。

7.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.4 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

7.5 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权证投资

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 本基金报告期内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。

7.8.2 本基金报告期内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。

7.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	银行存款	27,410.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	276.70
5	应收申购款	80,156.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,273.47

7.8.4 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可转换债券。

7.8.5 报告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的情况。

7.8.6 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。

§ 8 开放式基金份额变动

序号	名称	金额(元)
1	期初基金份额	1,126.80
2	申购基金份额	102.44
3	赎回基金份额	-
4	基金份额变动	989,213.66
5	期末基金份额	989,213.66
6	基金份额	989,213.66

注:本基金本报告期末基金份额持有人人数为二百零二人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 9 基金投资组合报告

9.1 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	-	-
2	固定收益	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	619,684.38	1.30
8	其他资产	981,624.38	1.96
9	合计	51,113,824.02	100.00

9.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

9.2.1 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)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	制造业	50,728,240.00	98.52
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
D	建筑业	-	-
E	交通运输、仓储业	-	-
F	信息、计算机和通信技术服务	800,000.00	1.53
G	金融业	-	-
H	房地产业	-	-
I	其他行业	-	-
J	其他行业	-	-
K	其他行业	-	-
L	其他行业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-
U	其他行业	-	-
V	其他行业	-	-
W	其他行业	-	-
X	其他行业	-	-
Y	其他行业	-	-
Z	其他行业	-	-
合计		51,113,824.02	100.00

9.2.2 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。

9.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9.4 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

9.5 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权证投资

注:本基金本报告期末未持有权证。

9.6 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。

9.7 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。

9.8 投资组合报告附注

9.8.1 本基金报告期内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。

9.8.2 本基金报告期内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。

9.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	银行存款	27,410.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	276.70
5	应收申购款	80,156.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,273.47

9.8.4 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可转换债券。

9.8.5 报告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的情况。

9.8.6 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。

§ 10 开放式基金份额变动

序号	名称	金额(元)
1	期初基金份额	1,126.80
2	申购基金份额	102.44
3	赎回基金份额	-
4	基金份额变动	989,213.66
5	期末基金份额	989,213.66
6	基金份额	989,213.66

注:本基金本报告期末基金份额持有人人数为二百零二人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 11 基金投资组合报告

11.1 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	-	-
2	固定收益	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	619,684.38	1.30
8	其他资产	981,624.38	1.96
9	合计	51,113,824.02	100.00

11.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

11.2.1 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)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	制造业	50,728,240.00	98.52
C	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
D	建筑业	-	-
E	交通运输、仓储业	-	-
F	信息、计算机和通信技术服务	800,000.00	1.53
G	金融业	-	-
H	房地产业	-	-
I	其他行业	-	-
J	其他行业	-	-
K	其他行业	-	-
L	其他行业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-
U	其他行业	-	-
V	其他行业	-	-
W	其他行业	-	-
X	其他行业	-	-
Y	其他行业	-	-
Z	其他行业	-	-
合计		51,113,824.02	100.00

11.2.2 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。

11.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

11.4 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

11.5 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权证投资

注:本基金本报告期末未持有权证。

11.6 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。

11.7 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。

11.8 投资组合报告附注

11.8.1 本基金报告期内前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门