

中银量化价值混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年一月二十二日
§ 1 重要提示

基金管理人的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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2019年1月21日复核了本报告中的财务数据、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当阅读本产品的招募说明书。

本报告期自2010年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
赵华华	基金经理	2017-11-21~	-	12

注:1. 首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非前任基金经理的“任职日期”均为根据公司决定确定的聘任日期；2. 从业人员限售期是指从证券业从业人员开始担任本基金基金经理之日起，该人员不得买卖本公司股票的期限。

§ 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(2018年10月1日-2018年12月31日)
1.本期三四季报盈		-16,989,707.61
2.本期利润		-21,234,034.66
3.期权平仓损益分部利润		-6,097.91
4.本期末利润净值		166,041,640.02
5.期末基金份额净值		0.7063

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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实得收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.13%	1.26%	1.11%	1.21%	-0.02%	-0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中银量化价值混合型证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图对比如图(2017年11月24日至2018年12月31日)

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期,截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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间	证券从业年限	说明
赵华华	基金经理	2017-11-21~	-	12

注:1. 首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非前任基金经理的“任职日期”均为根据公司决定确定的聘任日期；2. 从业人员限售期是指从证券业从业人员开始担任本基金基金经理之日起，该人员不得买卖本公司股票的期限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》,中国证监会和自律规则的有关规定,履行诚实守信、勤勉尽责的职责,确保基金的运作符合法律法规和基金合同的规定。

4.3 管理人对宏观经济、证券市场及基金业绩的专项说明

4.3.1 公平交易专项说明

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.3 公平交易制度的执行情况

4.3.4 报告期内基金投资组合类别的分布情况

4.3.5 投资组合报告

4.3.6 期末基金资产组合

4.3.7 期末持有的债券投资情况

4.3.8 期末持有的股票投资情况

4.3.9 期末持有的其他证券投资

4.3.10 期末按行业分类的股票投资组合

4.3.11 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组合

4.3.12 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组合

4.3.13 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组合

4.3.14 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

4.3.15 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险及当日合约投资组合

4.3.16 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指期货投资组合

4.3.17 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名国债期货投资组合

4.3.18 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期权投资组合

4.3.19 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名商品期货投资组合

4.3.20 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名外汇投资组合

4.3.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资组合

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

4.4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》,中国证监会和有关法律法规的规定,严格遵循基金基金合同,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,在严格控制风险的基础上,确保基金持有人利益的最大化。

4.4.3 报告期内基金投资组合类别的分布情况

4.4.4 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.5 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.6 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.7 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.8 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.9 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.10 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.11 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.12 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.13 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.14 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.15 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.16 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.17 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.18 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.19 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.20 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.21 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.22 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.23 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.24 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.25 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.26 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.27 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.28 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.29 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.30 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.31 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.32 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.33 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.34 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.35 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.36 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.37 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.38 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.39 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.40 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.41 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.42 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.43 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.44 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.45 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.46 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.47 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.48 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.49 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.50 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.51 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.52 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.53 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.54 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.55 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.56 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.57 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.58 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.59 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.60 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.61 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.62 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.63 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.64 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.65 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.66 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.67 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.68 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.69 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.70 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.71 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.72 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.73 报告期内基金投资组合的变化情况

4.4.74 报告期内基金投资组合的变化情况