

# 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

## 2019年第一季度报告

基金管理人:银华基金管理股份有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
报告送出日期:2019年4月18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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月16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2019年1月1日起至3月31日止。

### § 2 基金产品概况

基金名称	银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式
交易代码	002909
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年4月27日
报告期末基金份额总额	313,886,124.97份
投资目标	本基金使用大数据的分析技术,从大量多样化的证券和大数据中,挖掘出有价值的信息用于资产配置和组合优化,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金运用大数据的分析技术,从大量多样化的证券和大数据中,挖掘出有价值的信息用于资产配置和组合优化,力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	年化收益率8%
风险收益特征	本基金为证券投资基金,属于证券投资基金中较高风险的品种,其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币型基金。
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	
1.本期已实现收益		-2,382,190.23	
2.本期利润		969,117.96	
3.本期基金份额持有人本期利润		0.0042	
4.期末基金资产净值		224,569,216.89	
5.期末基金份额净值		0.715	

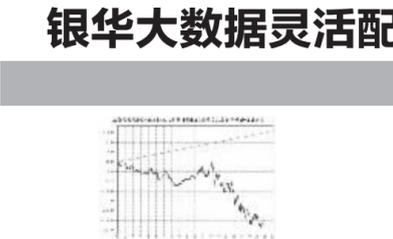
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

注:2、上述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。

3.2.1 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
过去三个月	2.29%	0.66%	1.21%	0.02%	1.08%	0.44%

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。

注: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。



注:按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例已符合基金合同的规定;在开放期内股票投资比例为基金资产的0%-95%,在封闭期股票投资比例为基金资产的0%-100%。投资比例符合基金合同约定的投资比例。

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时间	证券从业年限	说明
王树刚	本基金基金经理	2016年7月1日	14年	硕士学位,毕业于中国人民大学,2009年7月加入银华基金管理有限公司,曾任银华多利宝货币市场基金基金经理、银华多利宝定期开放混合型证券投资基金基金经理、银华多利宝灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2016年7月1日起担任银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2016年7月1日起担任银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2016年7月1日起担任银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2016年7月1日起担任银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理。
刘洪林	本基金基金经理	2016年4月7日	14年	硕士学位,毕业于中国人民大学,2009年7月加入银华基金管理有限公司,曾任银华多利宝货币市场基金基金经理、银华多利宝定期开放混合型证券投资基金基金经理、银华多利宝灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2016年4月7日起担任银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2016年4月7日起担任银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理,自2016年4月7日起担任银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金基金经理。

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。

注: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情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施规定,《银华大数据灵活配置定期开放混合型证券投资基金合同》及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、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,保证公平对待旗下所有基金。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,上证指数上涨23.93%,深证成指上涨36.84%,创业板指数上涨35.42%,在宏观经济企稳、流动性宽松、政策预期指引下,市场对经济修复的预期明显增强。一季度总体市场表现良好,行情更多来自于市场情绪的修复,而非盈利改善。二季度市场表现分化,行情更多来自于市场情绪的修复,而非盈利改善。二季度市场表现分化,行情更多来自于市场情绪的修复,而非盈利改善。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.715元;本报告期基金份额净值增长率为-22.9%,业绩比较基准收益率为1.21%。

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,本基金资产净值连续六十个工作日低于基金资产净值低于五千万元的情形,本基金管理人已于2019年3月26日,向中国证监会报告并提出解决方案。

4.7 投资组合报告

4.7.1 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	114,327,838.61	60.83
2	固定收益	774,448.27	0.34
3	买入返售金融资产	224,912,287.77	100.00
4	其他资产	-	-
5	合计	340,014,574.65	100.00

4.7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	农林牧渔	-	-
2	医药生物	-	-
3	信息技术	-	-
4	金融地产	-	-
5	可选消费	-	-
6	日常消费	-	-
7	工业周期	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

4.7.3 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	180207	180207	200,000	20,010,000.00	8.91

4.7.4 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	180207	180207	200,000	20,010,000.00	8.91

4.7.5 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贵金属投资明细

无。

4.7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

4.7.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

4.7.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

4.7.9 投资组合报告附注

4.7.9.1 报告期内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。

4.7.9.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

4.7.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,233.73
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	747,214.54
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,448.27

4.7.9.4 报告期末本基金持有的权证情况

无。

4.7.9.5 报告期末本基金持有的贵金属情况

无。

4.7.9.6 报告期末本基金持有的国债期货投资交易情况说明

无。

4.7.9.7 报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明

无。

4.7.9.8 投资组合报告附注

4.7.9.8.1 报告期内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。

4.7.9.8.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

4.7.9.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,233.73
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	747,214.54
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,448.27

4.7.9.8.4 报告期末本基金持有的权证情况

无。

4.7.9.8.5 报告期末本基金持有的贵金属情况

无。

4.7.9.8.6 报告期末本基金持有的国债期货投资交易情况说明

无。

4.7.9.8.7 报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明

无。

4.7.9.8.8 投资组合报告附注

4.7.9.8.8.1 报告期内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。

4.7.9.8.8.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

4.7.9.8.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,233.73
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	747,214.54
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,448.27

4.7.9.8.8.4 报告期末本基金持有的权证情况

无。

4.7.9.8.8.5 报告期末本基金持有的贵金属情况

无。

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,保证公平对待旗下所有基金。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,上证指数上涨23.93%,深证成指上涨36.84%,创业板指数上涨35.42%,在宏观经济企稳、流动性宽松、政策预期指引下,市场对经济修复的预期明显增强。一季度总体市场表现良好,行情更多来自于市场情绪的修复,而非盈利改善。二季度市场表现分化,行情更多来自于市场情绪的修复,而非盈利改善。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.715元;本报告期基金份额净值增长率为-22.9%,业绩比较基准收益率为1.21%。

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,本基金资产净值连续六十个工作日低于基金资产净值低于五千万元的情形,本基金管理人已于2019年3月26日,向中国证监会报告并提出解决方案。

4.7 投资组合报告

4.7.1 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	114,327,838.61	60.83
2	固定收益	774,448.27	0.34
3	买入返售金融资产	224,912,287.77	100.00
4	其他资产	-	-
5	合计	340,014,574.65	100.00

4.7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	农林牧渔	-	-
2	医药生物	-	-
3	信息技术	-	-
4	金融地产	-	-
5	可选消费	-	-
6	日常消费	-	-
7	工业周期	-	-
8	其他	-	-
9	合计	-	-

4.7.3 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	180207	180207	200,000	20,010,000.00	8.91

4.7.4 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	180207	180207	200,000	20,010,000.00	8.91

4.7.5 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贵金属投资明细

无。

4.7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

4.7.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

4.7.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

4.7.9 投资组合报告附注

4.7.9.1 报告期内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。

4.7.9.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

4.7.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,233.73
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	747,214.54
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,448.27

4.7.9.3.4 报告期末本基金持有的权证情况

无。

4.7.9.3.5 报告期末本基金持有的贵金属情况

无。

4.7.9.3.6 报告期末本基金持有的国债期货投资交易情况说明

无。

4.7.9.3.7 报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明

无。

4.7.9.3.8 投资组合报告附注

4.7.9.3.8.1 报告期内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。

4.7.9.3.8.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

4.7.9.3.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,233.73
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	747,214.54
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,448.27

4.7.9.3.8.4 报告期末本基金持有的权证情况

无。

4.7.9.3.8.5 报告期末本基金持有的贵金属情况

无。

4.7.9.3.8.6 报告期末本基金持有的国债期货投资交易情况说明

无。

4.7.9.3.8.7 报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明

无。

4.7.9.3.8.8 投资组合报告附注

4.7.9.3.8.8.1 报告期内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。

4.7.9.3.8.8.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

4.7.9.3.8.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,233.73
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	747,214.54
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,448.27

4.7.9.3.8.8.4 报告期末本基金持有的权证情况

无。

4.7.9.3.8.8.5 报告期末本基金持有的贵金属情况

无。

4.7.9.3.8.8.6 报告期末本基金持有的国债期货投资交易情况说明

无。

4.7.9.3.8.8.7 报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明

无。

4.7.9.3.8.8.8 投资组合报告附注

4.7.9.3.8.8.8.1 报告期内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。

4.7.9.3.8.8.8.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

4.7.9.3.8.8.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,233.73
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	747,214.54
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,448.27

4.7.9.3.8.8.8.4 报告期末本基金持有的权证情况

无。

4.7.9.3.8.8.8.5 报告期末本基金持有的贵金属情况

无。

4.7.9.3.8.8.8.6 报告期末本基金持有的国债期货投资交易情况说明

无。

4.7.9.3.8.8.8.7 报告期末本基金持有的股指期货交易情况说明

无。

4.7.9.3.8.8.8.8 投资组合报告附注

4.7.9.3.8.8.8.8.1 报告期内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。

4.7.9.3.8.8.8.8.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

4.7.9.3.8.8.8.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,233.73
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	747,214.54
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	774,448.27

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	国家债券	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
2	央行票据	-	-	-
3	金融债券	20,010,000.00	8.91	
4	企业债券	20,010,000.00	8.91	
5	企业短期融资券	-	-	-
6	中期票据	-	-	-
7	资产支持证券	-	-	-
8	可转债(可交换债)	-	-	-
9	其他	-	-	-
10	合计	20,010,000.00	8.91	

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	180207	180207	20		