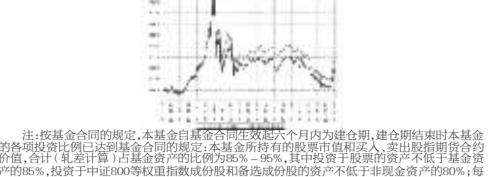


银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金

2019年第一季度报告

3.22 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期,建仓结束时本基金的资产构成为:股票占基金资产的比例(经资产配置比例调整后)为80%以上,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计(包括现金类资产)占基金资产的比例为15%-45%,其中投资于股票的资产不低于非货币资产的80%;每个交易日股票资产占基金资产的比例不低于60%。

基金经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。

基金管理人的董事会及董事对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的规定,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、误导性陈述或重大遗漏。

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基金的招募说明书。

本报告期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

基金简称 银华中证800等权重指数分级

基金代码 161025

基金合同生效日 2013年11月6日

报告期末基金份额总额 39,406,703份

投资目标 本基金为股票型基金,主要在中证800等权重指数的基础上,结合股票的行业配置和个股选择,力求超越业绩比较基准,追求基金资产的长期增值。

投资策略 本基金以行业配置为基础,在有效控制和降低风险的基础上,结合股票的行业配置和个股选择,力求超越业绩比较基准,追求基金资产的长期增值。

投资范围 本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,主要包括股票、权证、债券、货币市场工具、银行存款、短期融资券、回购协议、国债逆回购、资产支持证券、股指期货、商品期货、期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

投资限制 除法律法规或中国证监会另有规定外,本基金不得投资于股票、权证以外的金融工具。

投资基准 本基金的业绩基准为:中证800等权重指数×80%+银行存款利率(税后)×20%。

业绩比较基准 中证800等权重指数×80%+银行存款利率(税后)×20%

风险收益特征 高风险,高收益。

基金管理人 中国银河基金管理有限公司

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2019年1月1日~2019年3月31日)

本期利润 1,522,570.07

本利滚利 8,404,394.17

加权平均基金份额本期利润 0.0394

期末基金资产净值 33,900,731.04

基金份额净值 0.866

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.上述基金业绩指标不包括持有人认购基金的各项费用,例如:基金的申购、赎回费等,计算费用影响会导致基金业绩表现较差。

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(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 30.37% 16.14% 30.77% 1.61% -0.40% -0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同的约定,本基金自基金合同生效之日起六个月内为建仓期,建仓结束时本基金的资产构成为:股票占基金资产的比例(经资产配置比例调整后)为80%以上,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计(包括现金类资产)占基金资产的比例为15%-45%,其中投资于股票的资产不低于非货币资产的80%;每个交易日股票资产占基金资产的比例不低于60%。

基金经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。

基金管理人的董事会及董事对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、完整性和及时性负责。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,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、误导性陈述或重大遗漏。

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基金的招募说明书。

本报告期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。

§ 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 任本基金的基金期限 任期日期 说明

本基金的基金经理 陈晓东 2013年11月6日 至 2019年3月31日

说明:陈晓东先生,曾就职于美国花旗永续金融服务有限公司,巴克莱资本部分金融部高级经理,2010年6月10日担任本基金基金经理。

本基金的基金经理助理 陈晓东 2010年12月1日至2011年11月14日担任本基金基金经理助理。

本基金的基金经理助理 陈晓东 2011年12月1日至2012年11月14日担任本基金基金经理助理。

本基金的基金经理助理 陈晓东 2013年11月15日至2019年3月31日担任本基金基金经理助理。

本基金的基金经理助理 陈晓东 2014年4月1日至2019年3月31日担任本基金基金经理助理。

本基金的基金经理助理 陈晓东 2019年4月1日至至今担任本基金基金经理助理。

本基金的基金经理助理 陈晓东 2019年4月1日至至今担任本基金基金经理助理。