

金信量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018年第2季度报告

基金管理人: 金信基金管理有限公司 基金托管人: 招商银行股份有限公司

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...

基金概况表: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

投资目标 本基金主要关注具有良好盈利能力和成长性的证券, 通过积极主动的量化投资策略...

投资策略 本基金的投资策略主要有以下六个方面: 1. 资产配置策略 2. 行业配置策略 3. 个股选择策略

业绩比较基准 创业板指数收益率 x 35% + 沪深300指数收益率 x 35% + 中证综合债指数收益率 x 30%

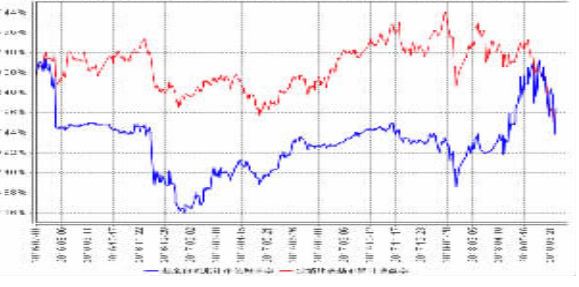
风险收益特征 本基金属于中高风险证券投资基金, 预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金...

基金管理人 金信基金管理有限公司 基金托管人 招商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现: 1. 本期已实现收益 2. 本期利润 3. 加权平均基金份额本期利润

基金净值表现: 阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准 业绩比较基准收益差④

基金业绩比较: 本基金自成立以来的基金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



基金管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介: 唐雷, 基金经理, 任职日期 2016年7月1日

基金管理人报告 4.2 报告期内基金投资策略和运作分析: 2018年二季度, 全球行业板块波动较大, 主要是受到中美贸易争端的影响...

表1: 银行地产行业2018年4月1日至2018年6月30日收益率(%)

基金管理人报告 4.3 报告期内基金投资组合资产配置情况: 权益投资 12,716,996.74 92.87

基金管理人报告 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合: 农林牧渔 0.00 采矿业 0.00

基金管理人报告 5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合: 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 报告期末按行业分类的债券投资组合: 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(%)

基金管理人报告 5.2 报告期末按品种分类的债券投资组合: 序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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(%)

基金管理人报告 5.2 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(%)

基金管理人报告 5.2 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明细: 序号 资产支持证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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: 序号 贵金属名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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: 序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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指期货投资明细: 序号 期货合约名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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国债期货投资明细: 序号 国债期货合约名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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货币资金投资明细: 序号 货币资金名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

金信智能中国 2025 灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018年第2季度报告

基金管理人: 金信基金管理有限公司 基金托管人: 招商银行股份有限公司

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...

基金概况表: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

投资目标 本基金重点投资在未来经济发展中提供智能化生产、设计与服务的企业...

投资策略 本基金的投资策略主要有以下五个方面: 1. 大类资产配置策略 2. 行业配置策略 3. 个股选择策略

业绩比较基准 中证智能主题指数收益率 x 85% + 中证综合债指数收益率 x 15%

风险收益特征 本基金属于中高风险证券投资基金, 预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金...

基金管理人 金信基金管理有限公司 基金托管人 招商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现: 1. 本期已实现收益 2. 本期利润 3. 加权平均基金份额本期利润

基金净值表现: 阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准 业绩比较基准收益差④

基金业绩比较: 本基金自成立以来的基金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



基金管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介: 唐雷, 基金经理, 任职日期 2016年7月1日

基金管理人报告 4.2 报告期内基金投资策略和运作分析: 2018年二季度, 全球行业板块波动较大, 主要是受到中美贸易争端的影响...

表1: 银行地产行业2018年4月1日至2018年6月30日收益率(%)

基金管理人报告 4.3 报告期内基金投资组合资产配置情况: 权益投资 12,716,996.74 92.87

基金管理人报告 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合: 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合: 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 报告期末按品种分类的债券投资组合: 序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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(%)

基金管理人报告 5.2 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(%)

基金管理人报告 5.2 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明细: 序号 资产支持证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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: 序号 贵金属名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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: 序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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指期货投资明细: 序号 期货合约名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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国债期货投资明细: 序号 国债期货合约名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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货币资金投资明细: 序号 货币资金名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人: 金信基金管理有限公司 基金托管人: 招商银行股份有限公司

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...

基金概况表: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额

投资目标 本基金重点投资在未来经济发展中提供智能化生产、设计与服务的企业...

投资策略 本基金的投资策略主要有以下五个方面: 1. 大类资产配置策略 2. 行业配置策略 3. 个股选择策略

业绩比较基准 中证智能主题指数收益率 x 85% + 中证综合债指数收益率 x 15%

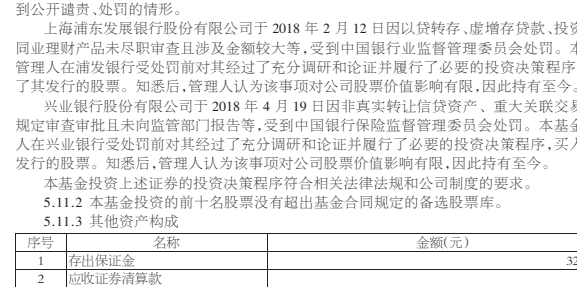
风险收益特征 本基金属于中高风险证券投资基金, 预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金...

基金管理人 金信基金管理有限公司 基金托管人 招商银行股份有限公司

主要财务指标和基金净值表现: 1. 本期已实现收益 2. 本期利润 3. 加权平均基金份额本期利润

基金净值表现: 阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准 业绩比较基准收益差④

基金业绩比较: 本基金自成立以来的基金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



基金管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介: 唐雷, 基金经理, 任职日期 2016年7月1日

基金管理人报告 4.2 报告期内基金投资策略和运作分析: 2018年二季度, 全球行业板块波动较大, 主要是受到中美贸易争端的影响...

表1: 银行地产行业2018年4月1日至2018年6月30日收益率(%)

基金管理人报告 4.3 报告期内基金投资组合资产配置情况: 权益投资 12,716,996.74 92.87

基金管理人报告 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合: 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合: 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 报告期末按品种分类的债券投资组合: 序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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(%)

基金管理人报告 5.2 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(%)

基金管理人报告 5.2 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明细: 序号 资产支持证券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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: 序号 贵金属名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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: 序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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指期货投资明细: 序号 期货合约名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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国债期货投资明细: 序号 国债期货合约名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

基金管理人报告 5.2 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货币资金投资明细: 序号 货币资金名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)