

## ❖ 为何选择基金重仓

1. A 股机构化是未来的发展趋势，机构投资者的动向值得关注。
2. 公募基金是 A 股最大的机构投资者，而且公募基金的信息披露及时透明，观察基金重仓股对实际投资具有较强的指导意义。
3. 优选基金中精选出持仓权重靠前的超配股票，构成优选基金超配组合。
4. 这些超配股票都是基金经理精选挑选的，具有强烈信心的战略性重仓配置品种，普遍具有明朗的成长前景和较高的投资价值，可以更好地反映基金经理的投资思路。

## ❖ 基本方法

米望科技-沪深-300SmartBeta-基金重仓组合策略在每个季度末,筛选出公募基金规模大于 5 亿且过去一年业绩表现排名前 10%的基金,然后挑选出基金的十大权重股,以最小化跟踪误差为目标函数优化股票权重构建组合。

## ❖ 持仓净值

单位净值



组合表现

	1 年	3 年	5 年	10 年	至今
组合资产	40.76%	62.92%	75.97%	-	235.74%
标的资产	28.09%	30.15%	21.14%	-	125.68%

## 说明

\*过往表现并不能保证未来，提供用于说明目的的图表和图形可能反映假设历史业绩或历史回溯测算结果，投资损益因应市场变化可能发生改变。

\*以上数据及图表皆以北京时间零时作为结算时间。

## 相关数据

起始日:	2014/4/1
标的资产:	沪深 300 指数
最近一月收益率:	4.36%
股票数:	173

## 组合属性

Beta:	0.97
跟踪误差:	3.5%
年化收益率:	21.5%
基准年化收益率:	13.9%

## 名词解释

**Beta 系数**是一个用来衡量个别资产或资产投资组合相对于基准资产的价格波动敏感性的指标。

**行业因子**是表示公司所属行业的一个分类属性，不同因子在不同行业内的表现差异较大。A 股市场有数种不同的行业分类方法，本报告行业定义默认采用申万行业分类。

**市值因子**是反映公司规模指标的，公司的市值代表着一个公司的经营规模和发展状况，也代表着公司的现阶段的实力和未来发展的潜力。市值(规模)因子是 A 股市场上表现较为突出的风险因子。

十大持仓			行业配置		
代码	名称	持仓权重	序列	行业分类	持仓权重
600519. XSHG	贵州茅台	7.55%	1.	食品饮料	14.73%
000858. XSHE	五粮液	4.21%	2.	医药生物	14.12%
000651. XSHE	格力电器	3.99%	3.	电子	7.93%
002352. XSHE	顺丰控股	3.07%	4.	房地产	7.72%
600276. XSHG	恒瑞医药	2.70%	5.	电气设备	7.01%
600383. XSHG	金地集团	2.62%	6.	农林牧渔	6.05%
000656. XSHE	金科股份	2.54%	7.	家用电器	5.26%
300498. XSHE	温氏股份	2.32%	8.	机械设备	4.65%
002415. XSHE	海康威视	2.26%	9.	化工	4.44%
600031. XSHG	三一重工	2.21%	10.	传媒	3.93%
			11.	汽车	3.53%
			12.	计算机	3.45%
			13.	交通运输	3.07%
			14.	建筑材料	2.57%
			15.	通信	2.48%
			16.	轻工制造	2.40%
			17.	休闲服务	1.65%
			18.	综合	1.10%
			19.	非银金融	1.02%
			20.	公用事业	0.69%
			21.	国防军工	0.69%
			22.	有色金属	0.68%
			23.	建筑装饰	0.39%
			24.	商业贸易	0.19%
			25.	采掘	0.12%
			26.	纺织服装	0.12%
			27.	其他	0.00%

免责声明，请仔细阅读

- 1.本文件为深圳米筐科技有限公司（以下简称“本公司”）就相关服务提供的唯一介绍材料，本公司未通过任何其他机构或者个人另行提供其他任何形式的介绍材料或作出关于本服务的任何承诺。
- 2.本文件及其内容均为本公司所有的保密信息，属于非公开材料，仅向少数特定客户提供，供其了解相关服务，未经本公司事先同意，本文件不可被复制或分发，亦不可向任何第三者披露或允许第三者公开使用。一旦阅读本文件，应被视为已同意此项条款。
- 3.本文件中所含来源于公开资料的信息，本公司对这些信息的准确性和完整性不做任何保证，也不保证所包含的信息不会发生任何变更，本公司已力求材料内容的客观、公正，但文中的信息仅供参考，不代表任何确定性的判断。
- 4.本公司不提供或推荐任何投资品种。本文件中所载的任何信息仅供参考，不构成任何明示或暗示的保证，不代表任何特定的投资策略和投资建议，也不得被视为法律、税务、财务、投资或其它方面的建议。本公司只向您提供信息，而不就您的任何行为承担任何责任，也不会对您的损益承担任何责任。
- 5.过往表现并不能保证未来的业绩。提供用于说明目的的图表和图形可能反映假设历史业绩或历史回溯测算结果。推出日期前提交的所有信息为历史回溯试算而非完全真实表现，不保证未来业绩。
- 6.除本页条款外，本文件其他内容和任何表述均属不具有法律约束力的用语，不应被归为构成向任何人士发出的要约或要约邀请，也不构成任何承诺。
- 7.本文件所含信息仅供参考，具体以您与本公司所签署的采购合同和其他法律文件为准。