

信息披露 Disclosure

中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

股票市场上,三季度上证指数下跌0.92%,代表大盘表现的沪深300指数下跌2.06%,中小板综合指数下跌10.41%,创业板综合指数下跌11.94%。风格上看,中小市值股票表现相对较弱。

3. 投资策略和运行情况
本报告期,本基金主要配置了云计算、新能源、上游、生物医药等行业,基金净值下跌4.4%。

二季度,在经济去杠杆深化的过程中,中美贸易摩擦对经济的下行加剧了新的因素,美国贸易保护主义进一步加剧,全球供应链下行压力加大,整个资产市场持续受到压制,防御类型的资产表现相对较好,但是更长期的周期来看,我们还是更看好新兴产业的发展前景,所以整体的配置方向没有发生大的调整。

展望四季度,对内,我们期待宏观政策能够相机抉择应对对新暴露出来的问题,这符合市场的中长期信心。对外,我们仍持续关注美国贸易保护主义,不确定性很大,但是确定的是很多行业产能过剩已经进入了估值底部区域,长期看,权益资产具备长期配置的价值。中银蓝筹仍致力于挖掘优质核心资产,积极在新兴产业中寻找投资机会。

4. 报告期内本基金业绩表现
报告期内,本基金基金份额净值增长率为-0.44%,同期业绩比较基准收益率为-0.75%。

4.1 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金在报告期内未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情况。

5. 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	236,770,700.00	72.61
2	其中:股票	216,770,700.00	67.61
3	固定收益投资	62,004,498.28	19.84
4	其中:债券	62,004,498.28	19.84
5	其他	62,004,498.28	19.84
6	其中:货币市场基金	62,004,498.28	19.84
7	其他	62,004,498.28	19.84
8	合计	298,775,198.28	92.45

5.2 报告期末按行业分类的权益类投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	171,591,464.43	61.97
B	医药生物	171,591,464.43	61.97
C	制造业	171,591,464.43	61.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,591,464.43	61.97
E	建筑业	171,591,464.43	61.97
F	交通运输、仓储和邮政业	171,591,464.43	61.97
G	信息传输、软件和信息技术服务业	171,591,464.43	61.97
H	金融业	171,591,464.43	61.97
I	房地产业	171,591,464.43	61.97
J	有色金属业	171,591,464.43	61.97
K	其他	171,591,464.43	61.97
L	合计	298,775,198.28	92.45

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

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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.5 报告期末按行业分类的国债逆回购投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	171,591,464.43	61.97
B	医药生物	171,591,464.43	61.97
C	制造业	171,591,464.43	61.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,591,464.43	61.97
E	建筑业	171,591,464.43	61.97
F	交通运输、仓储和邮政业	171,591,464.43	61.97
G	信息传输、软件和信息技术服务业	171,591,464.43	61.97
H	金融业	171,591,464.43	61.97
I	房地产业	171,591,464.43	61.97
J	有色金属业	171,591,464.43	61.97
K	其他	171,591,464.43	61.97
L	合计	298,775,198.28	92.45

5.6 报告期末按行业分类的国债逆回购投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	171,591,464.43	61.97
B	医药生物	171,591,464.43	61.97
C	制造业	171,591,464.43	61.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,591,464.43	61.97
E	建筑业	171,591,464.43	61.97
F	交通运输、仓储和邮政业	171,591,464.43	61.97
G	信息传输、软件和信息技术服务业	171,591,464.43	61.97
H	金融业	171,591,464.43	61.97
I	房地产业	171,591,464.43	61.97
J	有色金属业	171,591,464.43	61.97
K	其他	171,591,464.43	61.97
L	合计	298,775,198.28	92.45

5.7 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.8 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.9 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.10 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.11 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.12 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.13 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.14 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.15 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.16 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.17 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.18 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.19 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.20 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.21 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.22 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.23 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.24 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.25 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	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111	光大银行	350,410	16,286,427.60	5.87
3	120014	宇通客车	144,864	16,286,427.60	5.87

5.26 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170011	国信证券	200,000	20,014,000.00	7.21
2	110111				