

中银新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

消费增速较2018年末持平至2.5%，制造业投资高位回落，房地产投资暂时转弱，基建投资延续反弹，1-2月固定资产投资增速较2018年末继续小幅回升至1.6%的水平。通胀方面，CPI和PPI见底，2月同比增速下行至1.5%，PPI在工业价格走低及基建效应下延续回落，2月同比增速较2018年末回落至-1.1%。

2. 市场回顾
一季度市场信贷大幅扩张，社融企稳回升，市场流动性有积极改善，政策逻辑持续利好，市场风险偏好回升，上证指数上涨23.05%，沪深300指数上涨28.62%，中小板指数上涨36.66%，创业板上涨36.43%。

3. 投资回顾和运作分析
年初本基金仓位较低，结构偏保守，之后本基金逐渐提升仓位，结构上和行业上，加大行业优质公司配置比重。未来一个季度我们将精选行业优质个股，为投资者创造应有的回报。

4.5报告期内基金的投资策略和业绩表现
报告期内，本基金份额净值增长率为18.28%，同期业绩比较基准收益率为16.73%。

4.6报告期内基金持有人人数或基金资产净值披露说明
本基金在报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	49,747,049.19	76.34
2	固定收益投资	49,747,049.19	76.34
3	固定收益投资	11,019.00	0.02
4	其中:债券	11,019.00	0.02
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	16,262,739.67	23.66
11	其他各项资产	63,013.61	0.08
12	合计	65,166,067.47	100.00

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(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	医药	-	-
C	制造业	23,822,806.44	36.89
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	1,114,542.00	1.82
F	批发和零售业	2,908,424.00	4.49
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	5,639,700.68	9.20
J	金融业	11,048,140.66	18.06
K	房地产业	3,252,296.00	5.13
L	租赁和商务服务业	1,842,104.00	2.91
M	科学研究和技术服务业	28,494.41	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、管理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		49,747,049.19	81.19

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票

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

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	000036	招商银行	86,803	2,944,307.76	4.81
2	601318	中国平安	37,967	2,927,256.70	4.78
3	300014	亿纬锂能	99,595	2,428,126.10	3.96
4	002607	中公教育	160,100	2,062,088.00	3.27
5	600031	三一重工	147,436	1,889,788.68	3.05
6	002439	润兴股份	62,430	1,889,032.00	3.05
7	601888	中国国航	267,300	1,843,104.00	3.01
8	000401	黄金东来	101,660	1,788,199.40	2.92
9	600001	新华水电	76,500	1,751,850.00	2.89
10	000522	汇通股份	38,562	1,724,616.40	2.81

5.4 报告期末按债券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(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	11,019.00	0.02
9	其他债券	-	-
10	合计	11,019.00	0.02

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	110051	中债转债	100	11,019.00	0.02

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证

5.9 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.9.1 报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未参与股指期货投资

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近月合约。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.10.1 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未参与国债期货投资

5.10.2 本基金投资国债期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于国债期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近月合约。

5.11 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

5.11.1 报告期内本基金投资的期权持仓和损益明细

本基金本报告期末未参与期权投资

5.11.2 本基金投资期权的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于期权。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近月合约。

5.12 报告期末本基金投资的融资融券业务情况说明

本基金本报告期末未参与融资融券业务

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	001012	隆基股份	444,959	11,613,429.90	4.06
2	000438	通威股份	907,401	11,033,996.16	3.96
3	002607	中公教育	808,898	10,438,077.04	3.65
4	300049	华翔控股	246,497	9,241,693.43	3.22
5	600030	中信证券	264,894	9,042,072.32	3.16
6	000061	长生生物	20,434	6,477,373.66	2.26
7	600036	招商银行	190,675	6,474,480.00	2.26
8	300751	迈为股份	37,700	6,392,030.00	2.23
9	000002	万科A	206,804	6,353,018.88	2.22
10	603486	科大讯飞	101,200	6,165,104.00	2.16

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票

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

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	000036	招商银行	87,942	2,898,829.64	5.43
2	300047	泰康医药	174,163	11,547,090.00	5.11
3	300725	安科生物	106,319	10,381,203.83	4.69
4	300009	安科生物	62,118	6,196,148.89	3.94
5	300085	艾迪药业	126,641	7,536,751.35	3.33
6	300760	迈瑞医疗	53,896	7,228,889.80	3.24
7	000061	长生高新	21,000	6,646,790.00	2.90
8	600016	复星医药	194,503	5,752,290.34	2.56
9	300067	复星生物	115,475	5,695,848.00	2.43
10	600529	山东药业	200,000	5,100,000.00	2.28

5.4 报告期末按债券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(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	18,000.00	0.01
9	其他债券	-	-
10	合计	18,000.00	0.01

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	010906	国开1701	50,000	5,000,500.00	2.21
2	110229	德邦转债	180	18,000.00	0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证

5.9 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.9.1 报告期内本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未参与股指期货投资

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近月合约。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.10.1 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未参与国债期货投资

5.10.2 本基金投资国债期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于国债期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近月合约。

5.11 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

5.11.1 报告期内本基金投资的期权持仓和损益明细

本基金本报告期末未参与期权投资

5.11.2 本基金投资期权的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于期权。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的近月合约。

5.12 报告期末本基金投资的融资融券业务情况说明

本基金本报告期末未参与融资融券业务

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

E	电力、热力、燃气及水生产和供应业	--	--
F	建筑业	718,000.00	0.32
G	批发和零售业	14,191,839.30	6.28
H	交通运输、仓储和邮政业	2,794,000.00	1.24
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,784,594.14	4.77
J	金融业	134,343,000.00	60.00
K	房地产业	1,567,500.00	0.69
L	租赁和商务服务业	--	--
M	科学研究和技术服务业	7,036,643.21	3.11
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--

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(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	医药	-	-
C	制造业	143,267,279.91	63.26
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	718,000.00	0.32
F	批发和零售业	14,191,839.30	6.28
G	交通运输、仓储和邮政业	2,794,000.00	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	10,784,594.14	4.77
J	金融业	134,343.00	0.06
K	房地产业	1,567,500.00	0.69
L	租赁和商务服务业	7,038,643.31	3.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、管理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,675,853.16	10.42
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		204,068,010.02	90.24

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日

基金管理人:中银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十八日