交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

§1 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,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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19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、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管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本基金的招募说明书。

本报告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	交银国企改革灵活配置混合
基金主代码	519756
交易代码	519756
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月10日
报告期末基金份额总额	586,153,389.20份
投资目标	本基金主要投资受益于国企改革红利的上市公司股票,通过积极主动的投资管理,在合理控制投资风险的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上,运用修正后的投资时钟分析框架,自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略,确定债券组合久期和债券类别配置;在严谨深入的股票和债券研究分析基础上,自下而上精选个券。其中,本基金股票投资重点关注直接受益于国企改革红利、或在国企改革推动下盈利水平长期显著提升的其他上市公司。
业绩比较基准	60%×沪深300指数+40%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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)
1.本期已实现收益	11,193,626.46
2.本期利润	120,170,482.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.2008
4.期末基金资产净值	592,621,120.17
5.期末基金份额净值	1.011

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字;

2、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。

3.2 基金净值表现

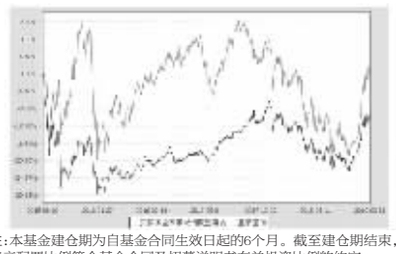
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	24.66%	1.29%	17.14%	0.93%	7.52%	0.36%

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由“60%×沪深300指数+40%×中信标普全债指数”变更为“60%×沪深300指数+40%×中证综合债券指数”,3.2.2同。详情见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计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

交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月10日至2019年3月31日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈楠	交银主题优选混合、交银国企改革灵活配置混合的基金经理	2015-06-10	-	10年	沈楠先生,复旦大学硕士。历任长江证券高级分析师,2011年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、基金经理助理。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易,遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则,全部通过交易系统进行比例分配;对于非集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年以来,国内经济总需求从中观行业观察有企稳迹象,相比2018年底的预期有明显改善。内部来看,财政政策趋于宽松,社融增速企稳,外部环境,中美贸易战的不确定性降低,双方达成协议的可能性较高。我们认为中期来看市场底部区域已经确认,短期伴随内外部环境的好转,市场继续处于可为阶段,2019年投资机会预计将多于2018年。

随着内外环境的改善,我们认为国企改革的进程在2019年将逐渐发力,部分领域例如混改试点进入执行效果落实观察期,并且新一批的混改试点将继续推行。全年来看,中央明确将稳步推进包括国企改革在内的一系列改革进程,因此我们继续看好该领域的投资机会。

本报告期内本基金重点配置了食品、医药、金融、地产、航空以及酒店等消费性行业,同时进一步增配了军工、制造国产化等成长性行业以及外国事业等稳定性行业。展望2019年二季度,我们认为重点区域的改革试点可以继续关注。考虑到贸易战的缓和,结构性投资机会预计将不断显现,市场的估值有望回升,主题趋于活跃。本产品将结合外部环境的变化,综合判断下一步改革试点的突破口,把握最新政策动向受益的国有企业。

4.5报告期内基金的业绩表现

本基金(各类)份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§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	502,583,251.62	80.27
	其中:股票	502,583,251.62	80.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,075,100.20	4.48
	其中:债券	28,075,100.20	4.48
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	91,646,158.00	14.64
8	其他各项资产	3,776,589.36	0.60
9	合计	626,081,099.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,628,000.00	3.48
C	制造业	186,293,101.67	31.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,462,616.92	4.47
E	建筑业	13,420,771.55	2.26
F	批发和零售业	34,645,900.94	5.85
G	交通运输、仓储和邮政业	45,738,982.00	7.72
H	住宿和餐饮业	17,471,682.20	2.95
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,801,541.00	3.17
J	金融业	64,882,498.65	10.95
K	房地产业	22,119,492.16	3.73
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,145,500.00	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	9,552,526.34	1.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	39,420,638.10	6.65
S	综合	-	-
	合计	502,583,251.62	84.81

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通过港股通投资的股票。

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	300413	芒果超媒	445,420	19,732,106.00	3.33
2	600030	中信证券	757,700	18,775,806.00	3.17
3	600038	中直股份	400,000	18,700,000.00	3.16
4	600258	首旅酒店	794,890	17,471,682.20	2.95
5	600029	南方航空	2,014,200	17,221,410.00	2.91
6	601398	工商银行	2,799,900	15,595,443.00	2.63
7	600048	保利地产	1,034,234	14,727,492.16	2.49
8	600967	内蒙一机	1,150,000	13,869,000.00	2.34
9	600406	国电南瑞	600,000	12,666,000.00	2.14
10	600115	东方航空	1,800,000	12,492,000.00	2.11

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	国家债券	27,857,200.00	4.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	217,900.20	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,075,100.20	4.74

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	199008	19贴现国债08	280,000	27,857,200.00	4.70
2	113517	曙光转债	1,740	217,900.20	0.04

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交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,684,610.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	61,038.24
5	应收申购款	30,940.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,776,589.36

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113517	曙光转债	217,900.20	0.04

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

本基金本报告期内未交易或持有基金。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	604,778,941.70
本报告期期间基金总申购份额	4,546,790.24
减:本报告期期间基金总赎回份额	23,172,342.74
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	586,153,389.20

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

8.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、关于申请募集注册交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书;

8、报告期内交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十日

§1 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,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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19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、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管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本基金的招募说明书。

本报告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	交银经济新动力混合
基金主代码	519778
交易代码	519778
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月20日
报告期末基金份额总额	519,708,628.38份
投资目标	本基金通过深度优选在经济新常态下受益于发展新动力的优质企业,分享因中国经济改革、创新和升级发展所带来的投资新机会,力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上,自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略,确定债券组合久期和债券类别配置;在严谨深入的股票和债券研究分析基础上,自下而上精选个券。其中,本基金所指的经济新动力是指改革动力、创新动力、升级动力,以及相关传统产业中的反转动力。本基金股票投资重点关注与经济新动力息息相关的优质企业,分享当前以中国经济改革、创新和升级发展所带来的投资新机会。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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)
1.本期已实现收益	6,053,557.35
2.本期利润	82,468,771.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.3940
4.期末基金资产净值	745,562,672.02
5.期末基金份额净值	1.4346

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字;

2、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。

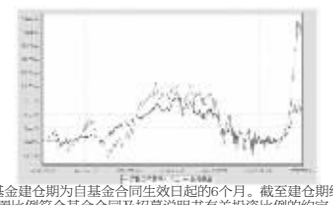
3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	45.20%	1.68%	17.14%	0.93%	28.06%	0.75%

3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计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

交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年10月20日至2019年3月31日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭斐	交银成长30混合、交银经济新动力混合的基金经理	2018-06-02	-	10年	郭斐先生,复旦大学经济学本科,2009年3月至2014年3月于高盛(亚洲)有限责任公司,高华证券公司任职。2014年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师、基金经理助理。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易,遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则,全部通过交易系统进行比例分配;对于非集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度,A股市场在全球风险偏好修复的大环境下迎来了久违的小阳春,较为宽松的货币环境以及优于预期的数据改善共同催生了“价值搭台、成长唱戏”的局面。

报告期内,本基金较早提升了仓位,重点配置了新能源汽车、智能装备、创新硬件、5G以及产业信息化等领域的成长股及以地产为代表的逆周期蓝筹品种。

展望2019年二季度,我们认为市场机遇与风险并存,重点关注经济止跌企稳的预期何时会被证实或证伪。在日渐升温的市场热情下,我们仍看到一批估值具备吸引力的优质成长股的存在,它们或顺应产业爆发的趋势,或有望成长为细分行业的隐形冠军。同时,以地产为代表的逆周期蓝筹品种仍然具备配置的价值。本基金将持续挖掘行业成长空间广阔、具备核心竞争力的公司,把握合适的配置窗口,力争为投资人获得持续稳定的超额回报。

4.5报告期内基金的业绩表现

本基金(各类)份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§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	669,235,859.01	88.58
	其中:股票	669,235,859.01	88.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	82,537,851.20	10.92
8	其他各项资产	3,774,020.86	0.50
9	合计	755,547,731.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,403,984.48	2.74
C	制造业	478,354,516.79	64.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,350,585.00	3.53
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	20,833,445.60	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,268,963.14	9.16
J	金融业	134,343.00	0.02
K	房地产业	50,660,341.00	6.79
L	租赁和商务服务业	-	-
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
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	669,235,859.01	89.76

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通过港股通投资的股票。

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	300014	亿纬锂能	2,923,093	71,265,007.34	9.56
2	603666	亿嘉和	1,026,360	69,402,463.20	9.31
3	603160	汇顶科技	476,113	49,420,529.40	6.63
4	300207	欣旺达	3,464,991	41,268,042.81	5.54
5	600480	凌云股份	3,269,964	40,547,553.60	5.44
6	000961	中南建设	3,404,300	32,340,850.00	4.34
7	300638	广和通	479,935	28,796,100.00	3.86
8	600131	岷江水电	1,412,900	26,350,585.00	3.53
9	601231	环旭电子	1,560,467	24,031,191.80	3.22
10	300682	朗新科技	917,400	20,861,676.00	2.80

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	87,897.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,132.09
5	应收申购款	3,659,991.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,774,020.86

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

本基金本报告期内未交易或持有基金。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	119,801,450.91
本报告期期间基金总申购份额	450,190,382.00
减:本报告期期间基金总赎回份额	50,283,204.53
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	519,708,628.38

注:1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出、份额类别调整业务,则总赎回份额中包含该业务。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

8.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会准予交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金募集注册的文件;

2、《交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于申请募集注册交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金的法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、报告期内交银施罗德经济新动力混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

金元顺安丰利债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年04月20日

§1 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,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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年04月19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、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管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本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安丰利债券
基金主代码	620003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年03月23日
报告期末基金份额总额	2,310,633,209.10份
投资目标	在注重资产安全性和流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的稳健收益和总回报。
投资策略	基于“自上而下”的原则,本基金采用久期控制下的主动性投资策略,并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。经过对历史数据的统计分析发现,债券市场收益率受到宏观经济形势和债券市场供需两方面不同程度的影响,因此本基金在债券投资过程中,将采用若干定量模型来对宏观和市场两方面数据进行分析,并运用适当的策略来构建债券组合。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金系债券型基金,其风险收益低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金,属于中低风险中低收益的证券投资基金品种。
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月01日-2019年03月31日)
1.本期已实现收益	55,378,228.35
2.本期利润	181,032,620.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0796
4.期末基金资产净值	2,498,232,023.88
5.期末基金份额净值	1.081

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、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数);

3、表中的“期末”均指报告期最后一日,即03月31日;

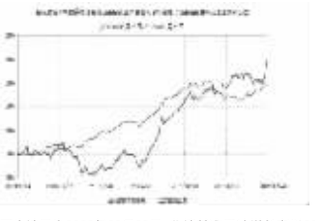
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.99%	0.42%	0.47%	0.05%	7.52%	0.37%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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



注:

1、本基金合同生效日为2009年03月23日,业绩基准累计增长率以2009年03月22日指数为基准;

2、本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%,其中对可转换债券(含分离交易可转债)的投资比例不高于基金资产的40%,对固定收益类以外