交银施罗德阿尔法核心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	交银阿尔法核心混合	
基金主代码	519712	
交易代码	519712(前端)	519713(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年8月3日	
报告期末基金份额总额	1,764,955,287.81份	
投资目标	本基金通过积极发挥团队选股优势,结合基本面多因子指标等组合管理手段选择具有显著阿尔法特征的个股,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,追求长期持续稳定高于业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的专业研究能力,以数量化工具辅助自上而下的资产配置,积极发挥研究团队的选股优势,结合基本面多因子指标自下而上精选个股,以谋求风险调整后的良好收益。	
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率	
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	202,793,781.81
2.本期利润	846,286,342.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.5299
4.期末基金资产净值	3,981,110,782.45
5.期末基金份额净值	2.256

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

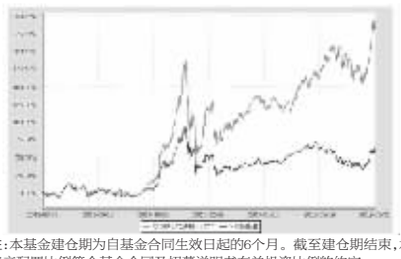
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	31.39%	1.57%	21.35%	1.16%	10.04%	0.41%

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×沪深300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",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

交银施罗德阿尔法核心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
(2012年8月3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		
何帅	交银优势行业混合、交银阿尔法核心混合、交银持续成长主题混合的基金经理	2015-09-16	-	9年	何帅先生,上海财经大学硕士,历任国联安基金管理有限公司研究员。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师。

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股市场回暖明显,上证指数上涨23.93%,创业板指数上涨35.43%。

本基金在一季度略有超额收益,主要原因是前期布局的优质公司表现较好,虽然我们并不以短期股价反映公司基本面,但持仓中大部分公司在2018年获得了明显正收益后,今年一季度依然获得了不错的收益,表现良好。

对于经济、利率及股票市场,我们目前持中性态度,经济增速预计仍有压力,与经济较为相关行业需求压力并未完全释放。股票市场从年初"很好的价格",上涨到目前基本达到"合理的价格",在此环境下我们预计以震荡走势为主。从中长期的角度,优秀的公司仍有较大的机会。只是目前,我们发现不少公司由于年初的上涨,基本实现今年的隐含回报率。

我们希望通过深度研究,找到需求可持续增长的行业,竞争力可持续拓宽的公司,享受公司价值的可持续成长,并希望以此能够持续为持有人获得超额收益。

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	3,314,181,889.98	82.35
	其中:股票	3,314,181,889.98	82.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,365,581.10	3.26
	其中:债券	131,365,581.10	3.26
	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	79,936,159.97	1.99
	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	433,907,187.73	10.78
8	其他各项资产	65,014,943.26	1.62
9	合计	4,024,405,762.04	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	514,400.00	0.01
C	制造业	935,066,037.05	23.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,610,000.00	0.04
E	建筑业	290,800.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	440,200.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,501,895,917.84	37.73
J	金融业	4,116,837.40	0.10
K	房地产业	111,477,569.73	2.80
L	租赁和商务服务业	297,249.26	0.01
M	科学研究和技术服务业	111,284,008.00	2.80
N	水利、环境和公共设施管理业	447,337.76	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	515,036,666.18	12.94
R	文化、体育和娱乐业	131,704,866.76	3.31
S	综合	-	-
	合计	3,314,181,889.98	83.25

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	002044	美年健康	16,754,258	311,461,656.22	7.82
2	300188	美亚柏科	17,887,581	307,845,269.01	7.73
3	300365	恒华科技	8,239,598	211,840,064.58	5.32
4	300078	思创医惠	16,485,904	179,366,635.52	4.51
5	002410	广联达	5,242,267	156,271,979.27	3.93
6	300271	华宇软件	6,823,047	145,126,209.89	3.65
7	600763	通策医疗	2,031,104	143,192,832.00	3.60
8	000681	视觉中国	4,996,391	131,704,866.76	3.31
9	300529	健帆生物	2,044,251	127,213,739.73	3.20
10	603232	格尔软件	2,894,317	121,850,745.70	3.06

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	49,745,000.00	1.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,048,000.00	2.01
	其中:政策性金融债	80,048,000.00	2.01
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)	1,572,581.10	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,365,581.10	3.30

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	180305	18进出05	800,000	80,048,000.00	2.01
2	199008	19贴现国债08	500,000	49,745,000.00	1.25
3	128061	启明转债	15,117	1,511,700.00	0.04
4	113011	光大转债	530	60,881.10	0.00

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	1,435,354.24
2	应收证券清算款	29,423,533.31
3	应收股利	-
4	应收利息	2,825,262.96
5	应收申购款	31,330,792.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,014,943.26

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	113011	光大转债	60,881.10	0.00

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300188	美亚柏科	307,845,269.01	7.73	重大事项

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	1,588,107,243.95
本报告期期间基金总申购份额	723,658,941.74
减:本报告期期间基金总赎回份额	546,810,897.88
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	1,764,955,287.81

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、中国证监会核准交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德阿尔法核心混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德阿尔法核心混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德阿尔法核心混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于募集交银施罗德阿尔法核心股票型证券投资基金之法律意见书;

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阿尔法核心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。

交银施罗德趋势优先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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	交银趋势混合	
基金主代码	519702	
交易代码	519702(前端)	519703(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年12月22日	
报告期末基金份额总额	253,584,612.77份	
投资目标	本基金力图通过把握中国人口变化的重大趋势,精选受益其中的优势行业和个股,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,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,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断未来人口趋势的重大转变对国民消费倾向、国家收入分配政策、产业升级和区域发展方向等战略决策的重要影响以及其中所蕴涵的行业投资机会的基础上,挖掘受益其中的优势行业,精选个股,以谋求超额收益。	
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率	
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	中国工商银行股份有限公司	

§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	-2,135,379.63
2.本期利润	77,733,159.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.3246
4.期末基金资产净值	368,986,385.52
5.期末基金份额净值	1.455

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

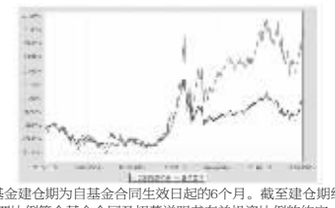
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	28.42%	1.51%	21.35%	1.17%	7.07%	0.34%

注:本基金业绩比较基准自2015年10月1日起,由"75%×沪深300指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",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

交银施罗德趋势优先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
(2010年12月22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		
韩威俊	交银趋势混合、交银策略回报灵活配置混合、交银消费新驱动股票、交银股息优化混合、交银品质升级混合的基金经理	2017-06-03	-	13年	韩威俊先生,上海财经大学金融学硕士,历任申银万国证券研究所助理分析师、北京鼎天资产管理有限公司董事助理、申银万国证券研究所行业分析师、信诚基金管理有限公司投资分析师。2013年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师。

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

回顾2019年一季度,外资大幅流入,国内流动性明显好转,中美贸易谈判出现缓和,市场对于整个宏观经济的预期有所好转。A股市场也出现了久违的春季大行情,从价值到主题,都出现了比较明显的涨幅。从目前情况来看,整个市场流动性继续出现大幅增长的可能性并不大,二季度宏观经济的回升幅度有待验证,A股的整体风险偏好继续上升的可能性并不大。

本基金在2019年一季度基本上维持消费白马龙头为底仓配置的大思路,消费白马在2018年四季度预期大幅下调以后,基本面出现了比较明显的好转,一季度表现相对较好。考虑到市场利率水平的下降以及整个地产产业链预期的好转,超配的地产行业也获得了比较明显的超额收益。三月中旬,适度做了一些个股上的更换,在消费和地产中,增加了一季报业绩增速较快的品种替代部分增速放缓品种。

展望2019年二季度,预计整体市场估值向下继续下调的可能性不大,结合市场流动性来看,目前TTM估值基本上也恢复到正常水平。二季度需要观察两个风险:一是美国经济是否会出现比较明显的回落,美股的回落可能对A股整体的情绪和流动性影响越来越大;二是关注后续M1、PPI和PM1等核心数据的变化,防止市场对于宏观经济预期的变化。

本基金在2019年二季度拟继续维持消费白马和地产底仓不发生太大变化,同时考虑适度降低仓位应对可能出现的风险。个股上,维持一季报增速较快公司的持仓不发生变化,一季报增速放缓的公司可能会考虑减持。此外,如果市场出现比较明显的回落,可能会逐步增加医药和计算机龙头公司的配置比例。

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	337,723,383.32	90.76
	其中:股票	337,723,383.32	90.76
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	31,752,690.95	8.53
8	其他各项资产	2,640,885.80	0.71
9	合计	372,116,960.07	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	-	-
C	制造业	242,905,104.12	65.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,848,902.94	1.04
J	金融业	134,343.00	0.04
K	房地产业	82,376,758.50	22.33
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,789,837.00	2.11
N	水利、环境和公共设施管理业	668,437.76	0.18
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	337,723,383.32	91.53

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	600519	贵州茅台	39,462	33,700,153.38	9.13
2	000858	五粮液	352,256	33,464,320.00	9.07
3	600887	伊利股份	1,129,535	32,880,763.85	8.91
4	600559	老白干酒	1,751,484	32,647,661.76	8.85
5	300146	汤臣倍健	1,409,971	32,217,837.35	8.73
6	600048	保利地产	1,646,933	23,452,325.92	6.36
7	601155	新城控股	464,494	20,971,904.10	5.68
8	603808	歌力思	1,197,112	20,865,662.16	5.65
9	603369	今世缘	637,342	18,291,715.40	4.96
10	603886	元祖股份	763,200	18,156,528.00	4.92

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	181,563.47
2	应收证券清算款	2,104,920.14
3	应收股利	-
4	应收利息	7,455.38
5	应收申购款	346,946.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,640,885.80

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	264,455,971.13
本报告期期间基金总申购份额	56,202,052.99
减:本报告期期间基金总赎回份额	67,073,411.35
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	253,584,612.77

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、中国证监会核准交银施罗德趋势优先股票证券投资基金募集的文件;

2、《交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金基金合同》;

3、《交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金招募说明书》;

4、《交银施罗德趋势优先混合型证券投资基金托管协议》;

5、关于申请募集交银施罗德趋势优先股票证券投资基金之法律意见书;

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趋势优先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。

金元顺安金元宝货币市场基金

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:宁波银行股份有限公司
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。

基金托管人宁波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	金元顺安金元宝货币	
基金主代码	620010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年08月01日	
报告期末基金份额总额	11,824,676,111.40份	
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报	
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,通过对内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对货币市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金系货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	金元顺安金元宝A类	金元顺安金元宝B类
下属分级基金的交易代码	620010	620011
报告期末下属分级基金的份额总额	32,130,430.24份	11,792,545,681.16份

§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)	
	金元顺安金元宝A类	金元顺安金元宝B类
1.本期已实现收益	285,961.03	92,569,214.42
2.本期利润	285,961.03	92,569,214.42
3.期末基金资产净值	32,130,430.24	11