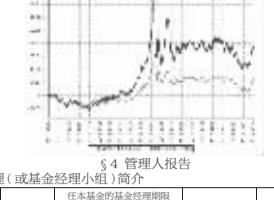


中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

收益率变动的比较



券)的收益率差异进行了分析,并采用连续四个季度期间内,不同时间窗口下(日内、3日、5日)同向交易的样本,构建95%置信区间下差价率的T检验显著程度进行分析,未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,基金管理人对异常交易行为进行分析,未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019一季度,市场呈现持续上涨的态势。整体来看,上证指数上涨23.93%,创业板指数上涨35.43%。从板块来看,表现居前的五个板块:农林牧业(中信)上涨48.80%,计算机(中信)上涨47.30%,非金属(中信)上涨42.39%,饮料食品(中信)上涨42.37%,电子元器件(中信)上涨41.56%。表现倒数前五名的板块:银行(中信)上涨16.39%,电力及公用事业(中信)上涨17.09%,建筑(中信)上涨18.38%,石油石化(中信)上涨18.38%,采掘(中信)上涨18.38%。整体来看,一季度在科技股的带领下,市场呈现普涨的格局,其中大金融板块表现相对弱势,但整体表现依然较好,同时市场风格切换较快,我们也将仓位及时调整。

一季度当期主要配置集中在由业绩驱动的科技股,以计算机、高端制造、军工、大金融为主,同时保持2成仓位,后市市场风格好转,我们也将及时提升仓位。

4.5 报告期内基金净值表现

截至报告期末本基金净值为1.6112元,累计净值为1.944元;本报告期基金份额净值增长率为25.55%,业绩比较基准收益率为19.06%。

4.6 报告期内基金费用情况

报告期内本基金持有或处置的股票、债券等资产均无费用产生。

4.7 投资组合报告

5.1 报告期内基金资产组合情况

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 420,960,980.00 43.544,580.00 7.95%

2 衍生工具 300,000.00 31,472,030.00 6.10%

3 固定收益 1,000,000.00 25,100,000.00 4.07%

4 货币市场 1,190,012.00 23,050,207.02 3.74%

5 银行存款 999,961.00 21,269,730.47 3.46%

6 600028 中邮基金 449,946.00 21,034,975.60 3.41%

7 200067 恒瑞医药 250,000.00 20,232,000.00 3.29%

8 600030 中信银行 799,085.00 19,823,628.20 3.21%

9 603029 律奇医疗 999,000.00 18,448,705.00 2.99%

10 000547 航天长峰 1,508,092.00 16,520,177.40 2.68%

注:由于四舍五入的原因报告公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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 000917 钢铁行业 240,960,980.00 43.544,580.00 7.95%

2 200044 海航国际 300,000.00 31,472,030.00 6.10%

3 000011 金业集团 1,000,000.00 25,100,000.00 4.07%

4 000006 丽珠集团 1,190,012.00 23,050,207.02 3.74%

5 000371 华宇软件 999,961.00 21,269,730.47 3.46%

6 600028 中邮基金 449,946.00 21,034,975.60 3.41%

7 200067 恒瑞医药 250,000.00 20,232,000.00 3.29%

8 600030 中信银行 799,085.00 19,823,628.20 3.21%

9 603029 律奇医疗 999,000.00 18,448,705.00 2.99%

10 000547 航天长峰 1,508,092.00 16,520,177.40 2.68%

注:由于四舍五入的原因报告公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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十名债券投资明细

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 国家债券 10,728,000.00 10,728,000.00 1.74%

2 衍生工具 - - -

3 金融债券 - - -

4 固定期限投资 - - -

5 企业短期债券 - - -

6 中长期债券 - - -

7 可转换(可交换)债券 - - -

8 同业存单 - - -

9 其他 - - -

10 合计 10,728,000.00 10,728,000.00 1.74%

注:由于四舍五入的原因报告公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 A 级, 林, 渔, 渔业 - - -

2 B 级矿业 7,019,061.00 1.23%

3 制造业 299,000.1434 0.052%

4 D 级, 热力, 水气及水生产, 和供应业 - - -

5 E 级, 建筑业 - - -

6 F 级, 批发零售业 - - -

7 G 级, 交通运输, 存储及维修服务 - - -

8 H 级, 文化, 体育及娱乐业 5,900,000.00 0.90%

9 I 级, 合计 637,270,000.00 10.00%

注:由于四舍五入的原因报告期因基金资产组合项目金额占基金总资产的比例如分项之和与合计可能有尾差。

5.7 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有境内股票。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息

5.9 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2. 中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3. 中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议

4. 中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

5. 基金管理人业务资格批件,营业执照

6. 基金管理人业务资格批件,公告执照

7. 报告期内本基金持有的各项定期存款的合同及利率

8. 基金管理人最近一期的资产负债表

9. 基金投资组合报告附注

10. 本报告期未出现重大诉讼、仲裁事项

11. 本报告期未出现影响投资者决策的重大事件

12. 本报告期未出现影响投资者决策的重大风险提示

13. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

14. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

15. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

16. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

17. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

18. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

19. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

20. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

21. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

22. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

23. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

24. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

25. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

26. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

27. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

28. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

29. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

30. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

31. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

32. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

33. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

34. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

35. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

36. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

37. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

38. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

39. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

40. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

41. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

42. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

43. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

44. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

45. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

46. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

47. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

48. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

49. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

50. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

51. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

52. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

53. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

54. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

55. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

56. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

57. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

58. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

59. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

60. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

61. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

62. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

63. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易

64. 本报告期未出现影响投资者决策的重大关联交易