

目录
重要提示
基金基本情况
主要财务指标和基金净值表现
其他指标
管理人报告
公平交易专项说明
投资组合报告
其他重要事项

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。
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月31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。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes fields like 基金名称 (Fund Name), 场内简称 (Intra-market Abbreviation), 基金代码 (Fund Code), etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 报告期 (2019-01-01至2019-03-31) (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

基金净值表现

Table with columns: 阶段 (Stage), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation), etc.



注: 1、本基金成立于2015年6月24日正式生效，按照本基金合同的规定，基金管理人自合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。建仓期末时本基金各项资产配置比例符合基金合同规定。

其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (2019-01-01至2019-03-31) (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金基金经理的起止日期 (Start/End Date of Fund Management), 证券从业年限 (Securities Industry Experience), 说明 (Remarks).

注: 1、基金经理的任职日期为根据本基金合同约定确定的聘任日期; 2、基金经理的任职已按规定在中国证券投资基金业协会办理完毕基金经理注册;

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在认真控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人的利益的行为。

公平交易专项说明

基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及内部相关制度和流程，通过流程和系统控制保证有效实现公平交易管理要求，并通过对投资交易行为的监控和确认，确保基金管理人旗下各投资组合在投资决策、交易执行等各方面均得到公平对待。

异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未出现基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的3%的情况，基金管理人未发现异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2019年一季度，市场大幅上涨，中小板和创业板的涨幅显著大于上证指数。在行业板块方面，计算机和农牧渔板块的涨幅较大，主要原因是一季度股票市场的流动性较为充裕，以计算机为代表的成长股的估值显著提升；同时，非洲猪瘟影响了生猪的出栏，后续猪肉价格有较大的上涨空间。

报告期末基金的投资组合表现

本报告期末截至2019年3月31日，本基金份额净值为1.035元，累计份额净值为1.035元。报告期内基金份额净值为18.83%，同期业绩比较基准收益率为14.20%。

报告期末基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金自2019年1月18日起存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan), 占基金总资产的比例 (%) (Percentage of Total Assets).

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量 (股) (Quantity in Shares), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousands of RMB Yuan), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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

注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注: 根据本基金基金合同约定，本基金不参与贵金属投资。

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

注: 本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity Buy/Sell), 合约市值 (元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description).

注: 报告期内，本基金未参与股指期货交易；截至报告期末，本基金未持有股指期货合约。

本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同的规定，本基金将以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要用于流动性、交易结算期的锁仓。本基金在进行股指期货投资时，将通过对冲证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金不参与国债期货交易。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Quantity Buy/Sell), 合约市值 (元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动 (元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description).

注: 根据本基金基金合同约定，本基金不参与国债期货交易。

本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金不参与国债期货交易。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

其他资产构成

Table with columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in RMB Yuan).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 数量 (Quantity), 单位: 份 (Unit: Shares).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有基金份额变动情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金份额 (Fund Shares), 单位: 份 (Unit: Shares).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Transaction Shares), 交易金额 (元) (Transaction Amount in RMB Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

注: 本报告期，基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares), 发起份额总数 (Total Shares Initiated), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Initiated), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Holding Period for Initiated Shares).

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval when Holding Share Proportion Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Start Period Shares), 中购份额 (Mid-period Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Holding Shares), 份额占比 (Share Proportion).

产品特有风险

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件;
2、本基金基金合同;
3、本基金的托管协议;
4、本基金的招募说明书;
5、基金管理人业务资格牌照、营业执照;
6、基金托管人业务资格牌照、营业执照;
7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

存放地点

基金管理人、基金托管人处。

查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，还可以通过基金管理人网站查询或下载。