

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18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 基金简称 (Fund Name), 场内简称 (Intra-market Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), 基金合同生效日 (Fund Contract Effective Date), 报告期末基金份额总额 (Total Shares at Reporting End), 投资目标 (Investment Objective), 投资策略 (Investment Strategy), 业绩比较基准 (Benchmark), 风险收益特征 (Risk and Return Characteristics), 基金管理人 (Fund Manager), 基金托管人 (Fund Custodian).

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). Includes 本期已实现收益 (Realized Income), 本期利润 (Current Profit), 加权平均基金份额本期利润 (Weighted Average Profit per Share), 期末基金份额净值 (NAV at End), 期末基金份额净值 (NAV at End).

基金净值表现

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Std Dev), 业绩比较基准收益率③ (Benchmark Return), 业绩比较基准收益率标准差④ (Benchmark Return Std Dev), ①-③ (Difference), ②-④ (Difference). Includes 过去三个月 (Last 3 Months).

本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
大摩消费领航混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于2016年12月31日正式生效，按照本基金合同的规定，基金管理人自基金合同生效之日起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。建仓期间未对本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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). Includes 其他指标 (Other Indicators).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金基金经理期限 (Tenure as Fund Manager), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (Resignation Date), 证券从业年限 (Years of Securities Experience), 说明 (Remarks). Includes 王大鹏 (Wang Dapeng).

注：1、基金经理的任职日期与根据本基金合同规定确定的聘任日期；
2、基金经理的任职日期已在基金业协会基金从业人员管理信息系统备案；
3、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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利益的行为。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

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分析，确保基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待。本报告期内，基金管理人严格执行各项公平交易制度及流程。

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超过该证券当日成交量的5%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

2019年一季度A股市场震荡走强，上证综指上涨23.95%，沪深300指数上涨28.62%，创业板指上涨35.43%，其中农林牧渔、计算机、非银金融行业涨幅分别为48.80%、47.30%、42.39%，表现相对较好；建筑、电力及公用事业、银行涨幅分别为18.30%、17.09%、16.39%，表现相对较弱。一季度市场表现较好，主要因为估值处于历史低位区域，中美贸易谈判进展顺利，贸易摩擦有所缓和，以及政府出台了一系列的稳增长措施托底经济，包括全面降准、加大地方专项债发行、加大支持民营力度等。在内外市场压力得到缓解的背景下，市场风险偏好得到提升，投资者信心有所恢复。

一季度本基金在市场中保持相对稳健的配置，整体一季度以中高位仓位为主。1月持仓主要集中在医药、食品饮料、计算机等行业的龙头公司为主，业绩表现相对较好；春节后业绩全面反弹，主题投资相关个股表现活跃，本基金也适当增加了成长和主题板块的配置。一季度本基金业绩表现比较稳健。

展望二季度，稳增长政策进入落实和执行阶段，中美贸易谈判也即将取得显著进展，A股市场有望继续保持较好的政策、外部和资金环境。我们计划维持中高仓位，坚持基本面研究驱动投资的理念，相对看好5G、新能源汽车、智能驾驶等为代表的科技成长龙头，以及医药、食品饮料等为代表的必需消费，以机械、军工为代表的高端制造及大金融板块。

报告期内基金的业绩表现

本报告期末截至2019年3月31日，本基金份额净值为0.6865元，累计份额净值为0.6865元，报告期内基金份额净值增长率为25.23%，同期业绩比较基准收益率为15.59%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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或者基金资产净值低于五千万元的情况。

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). Includes 权益类投资 (Equity Investment), 其中：股票 (Of which: Stocks), 固定收益投资 (Fixed Income Investment), 其中：债券 (Of which: Bonds), 资产支持证券 (Asset-backed Securities), 贵金属投资 (Precious Metals Investment), 金融衍生品投资 (Financial Derivatives Investment), 买入返售金融资产 (Repurchase Agreements), 其中：买断式回购的买入返售金融资产 (Of which: Repurchase Agreements), 银行存款和结算备付金合计 (Total of Bank Deposits and Settlement Reserves), 其他资产 (Other Assets), 合计 (Total).

报告期末按行业分类的股票投资组合

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). Includes A 农、林、牧、渔业 (Agriculture, Forestry, Animal Husbandry, and Fishing), B 采矿业 (Mining), C 制造业 (Manufacturing), D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 (Electricity, Heat, Gas, and Water Supply), E 建筑业 (Construction), F 批发和零售业 (Wholesale and Retail Trade), G 交通运输、仓储和邮政业 (Transportation, Storage, and Postal Services), H 住宿和餐饮业 (Accommodation and Food Services), I 信息传输、软件和信息技术服务业 (Information, Communication, and Technology Services), J 金融业 (Finance), K 房地产业 (Real Estate), L 租赁和商务服务业 (Leasing and Business Services), M 科学研究和技术服务业 (Science, Research, and Technology Services), N 水利、环境和公共设施管理业 (Water Resources, Environment, and Public Facilities Management), O 居民服务、修理和其他服务业 (Residential Services, Repairs, and Other Services), P 教育 (Education), Q 卫生和社会工作 (Health and Social Work), R 文化、体育和娱乐业 (Culture, Sports, and Entertainment), S 综合 (General), 合计 (Total).

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). Includes A 基础材料 (Basic Materials), B 消费非必需品 (Consumer Non-durables), C 消费必需品 (Consumer Durables), D 金融 (Finance), E 医疗保健 (Healthcare), F 工业 (Industry), G 信息技术 (Information Technology), H 电信服务 (Telecommunications Services), I 公用事业 (Utilities), J 房地产 (Real Estate).

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). Includes 000661 长春高新 (Changchun Gaoxin), 002773 康乐药业 (Kangle Pharmaceutical), 603389 口子窖 (Kouzi Jiao), 603317 绝味食品 (Juewei Food), 600132 重庆啤酒 (Chongqing Beer), 603666 亿嘉和 (Yijiahe), 300347 泰格医药 (Taige Medical), 300633 开立医疗 (Kaili Medical), 002212 南药股份 (Nanyao Shares), 002821 洪兴泰 (Hongxingtai).

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). Includes 1 国家债券 (Government Bonds), 2 央行票据 (Central Bank Bills), 3 金融债券 (Financial Bonds), 其中：政策性金融债 (Of which: Policy Financial Bonds), 4 企业债券 (Corporate Bonds), 5 企业短期融资券 (Corporate Short-term Financing Notes), 6 中期票据 (Medium-term Notes), 7 可转换 (可交换) 债 (Convertible (Convertible) Bonds), 8 同业存单 (Interbank Deposits), 9 其他 (Other), 10 合计 (Total).

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 Thousand 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). Includes 123006 东财转债 (Dongcai Convertible Bond), 110943 无锡转债 (Wuxi Convertible Bond), 110940 华鼎转债 (Huading Convertible Bond), 113019 玲珑转债 (Linglong Convertible Bond).

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metals Code), 贵金属名称 (Precious Metals Name), 数量 (份) (Quantity in Units), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value).

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) (Position Size (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). Includes 公允价值变动总额合计 (元) (Total Fair Value Change in RMB Yuan), 股指期货投资本期收益 (元) (Futures Investment Income in RMB Yuan), 股指期货投资本期公允价值变动 (元) (Futures Investment Fair Value Change in RMB Yuan).

注：根据本基金基金合同约定，本基金不参与股指期货交易。

本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金不参与股指期货交易。

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) (Position Size (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). Includes 公允价值变动总额合计 (元) (Total Fair Value Change in RMB Yuan), 国债期货投资本期收益 (元) (Treasury Futures Investment Income in RMB Yuan), 国债期货投资本期公允价值变动 (元) (Treasury Futures Investment Fair Value Change in RMB Yuan).

注：根据本基金基金合同约定，本基金不参与国债期货交易。

本期国债期货投资评价

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未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). Includes 1 存出保证金 (Outstanding Margin), 2 应收证券清算款 (Receivable Settlements), 3 应收股利 (Receivable Dividends), 4 应收利息 (Receivable Interest), 5 应收申购款 (Receivable Subscriptions), 6 其他应收款 (Other Receivables), 7 其他 (Other), 8 其他 (Other), 9 其他 (Other), 10 合计 (Total).

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 公允价值 (元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 123006 东财转债 (Dongcai Convertible Bond), 110943 无锡转债 (Wuxi Convertible Bond), 110940 华鼎转债 (Huading Convertible Bond), 113019 玲珑转债 (Linglong Convertible Bond).

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), 数值 (Value), 单位: 份 (Unit: Shares). Includes 报告期期初基金份额总额 (Total Shares at Start of Reporting Period), 报告期申购基金份额总额 (Total Shares Purchased during Reporting Period), 减: 报告期赎回基金份额总额 (Total Shares Redeemed during Reporting Period), 报告期向基金拆分变动份额 (基金份额减少以“-”填列) (Change in Shares due to Fund Split (Shares Decreased by "-" Indicated)), 报告期末基金份额总额 (Total Shares at End of Reporting Period).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 项目 (Item), 基金金额 (Fund Amount), 单位: 份 (Unit: Shares). Includes 报告期末管理人持有的本基金份额 (Shares of this Fund Held by the Manager at Reporting End), 报告期末买入/申购总份额 (Total Shares Purchased/Bought during Reporting Period), 报告期末买入/赎回总份额 (Total Shares Redeemed during Reporting Period), 报告期末管理人持有的本基金份额 (Shares of this Fund Held by the Manager at Reporting End), 报告期末持有的本基金份额占本基金总份额比例 (%) (Percentage of Total Shares Held by the Manager at Reporting End).

注：本报告期，基金管理人未运用固有资金申购、赎回本基金。截至本报告期末，基金管理人未持有本基金份额。

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 Mode), 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).

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 Held), 发起份额总数 (Total Shares Issued), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Issued), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Holding Period for Issued Shares). Includes 基金管理人固有资金 (Fund Manager's Own Funds), 基金管理人高级管理人员 (Senior Management of the Fund Manager), 基金管理人基金经理等人员 (Fund Manager's Fund Managers and Others), 基金管理人股东 (Shareholders of the Fund Manager), 其他 (Other), 合计 (Total).

报告期内单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额达到或超过20%的时间区间 (Time Interval when Shares Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Shares at Start), 申购份额 (Shares Purchased), 赎回份额 (Shares Redeemed), 持有份额 (Shares Held), 份额占比 (Percentage of Shares). Includes 机构 (Institution), 个人 (Individual).

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
2、本基金基金合同；
3、本基金托管协议；
4、基金招募说明书；
5、基金管理人业务资格批复、营业执照；
6、基金托管人业务资格批复、营业执照；
7、报告期内按规定报送过的所有公告。

存放地点

基金管理人、基金托管人处。

查阅方式

投资者可在业务时间内免费查阅，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。