诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19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	诺安中证500ETF
场内简称	诺安500
交易代码	510520
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年2月7日
报告期末基金份额总额	7,090,964.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用完全复制法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%且不低于非现金基金资产的80%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证500指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

注:本基金上市交易的证券交易所为"上海证券交易所"。

§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	-37,183,295.92
2.本期利润	6,286,383.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.3414
4.期末基金资产净值	9,878,474.69
5.期末基金份额净值	1.3931

注:①上述基金业绩指标不包括持有人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。

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。

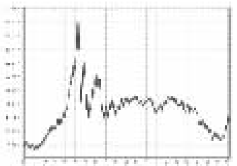
3.2 基金净值表现

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	27.85%	1.59%	33.10%	1.71%	-5.25%	-0.12%

注:本基金业绩比较基准:中证500指数收益率。

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:本基金的建仓期为3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
梅律吾	本基金基金经理	2014年2月7日	-	21	硕士,具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司;2005年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监、指数投资组副总监,现任指数组负责人。曾于2007年11月至2009年10月担任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2009年3月至2010年10月担任诺安成长股票型证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理,2011年9月至2012年11月担任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理,2017年8月至2017年10月任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2017年8月至2018年8月任诺安新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2015年6月至2019年1月任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年7月起任诺安中证100指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2014年2月起任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2017年8月起任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年8月起任诺安沪深300指数增强型证券投资基金基金经理,2019年1月起任诺安中证500指数增强型证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,主要原因在于投资组合采用不同的投资策略。经检查未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金的年化跟踪误差和日均跟踪偏离度均控制在了基金合同约定的范围之内。报告期内,本基金跟踪误差主要来自指数成份股调整和申购赎回,原因是在较小的最小申赎单位下,申购赎回清单文件中各股票的权重与标的指数相比产生了一定差异。本基金管理人完全遵循被动投资,尽可能地控制基金的跟踪误差与偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.3931元。本报告期基金份额净值增长率为27.85%,同期业绩比较基准收益率为33.10%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金在2019年1月9日至2019年3月29日期间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。

§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	9,519,468.05	93.53
	其中:股票	9,519,468.05	93.53
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	625,105.81	6.14
8	其他资产	33,326.26	0.33
9	合计	10,177,900.12	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	83,029.00	0.84
B	采矿业	272,905.07	2.76
C	制造业	5,316,739.72	53.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	292,893.30	2.96
E	建筑业	176,388.16	1.79
F	批发和零售业	486,746.24	4.93
G	交通运输、仓储和邮政业	346,574.28	3.51
H	住宿和餐饮业	28,113.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	956,382.22	9.68
J	金融业	346,353.88	3.51
K	房地产业	547,941.11	5.55
L	租赁和商务服务业	148,210.83	1.50
M	科学研究和技术服务业	12,900.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	63,525.00	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,133.00	0.05
Q	卫生和社会工作	59,358.00	0.60
R	文化、体育和娱乐业	227,274.00	2.30
S	综合	140,751.24	1.42
	合计	9,511,218.05	96.28

5.2.2 报告期末积极投资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	8,250.00	0.08
C	制造业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	8,250.00	0.08

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

5.3.1 报告期末指数投资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	603444	吉比特	300	61,929.00	0.63
2	000656	金科股份	7,700	56,210.00	0.57
3	000860	顺鑫农业	900	54,567.00	0.55
4	002195	二三四五	8,830	53,509.80	0.54
5	002384	东山精密	2,798	53,134.02	0.54
6	600256	广汇能源	11,920	51,852.00	0.52
7	000750	国海证券	8,400	51,744.00	0.52
8	000066	中国长城	4,582	48,431.74	0.49
9	300347	泰格医药	700	46,410.00	0.47
10	600872	中炬高新	1,265	46,273.70	0.47

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000693	*ST华泽	15,000	8,250.00	0.08

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定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	33,114.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	211.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,326.26

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	000693	*ST华泽	8,250.00	0.08	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	79,090,964.00
报告期期间基金总申购份额	30,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	102,000,000.00
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	7,090,964.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019.02.11-2019.02.13	-	6,016,000.00	6,016,000.00	-	-
	2	2019.02.11-2019.02.20	-	8,000,100.00	8,000,100.00	-	-
	3	2019.02.11-2019.02.20	-	14,000,400.00	14,000,400.00	-	-
个人	1	2019.01.10-2019.02.11 2019.02.25-2019.03.29	1,680,000.00	-	-	1,680,000.00	23.69%
中国银行股份有限公司－诺安中证500交易型开放式指数证券投资	1	2019.01.02-2019.01.08	72,000,000.00	-	72,000,000.00	-	-
产品特有风险							
本报告期内,本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金公开募集的文件。

②《诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》。

③《诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金2019年第一季度报告正文。

⑥报告期内诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2019年4月19日

诺安中证创业成长指数分级证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19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	诺安中证创业成长指数分级		
场内简称	诺安中创		
交易代码	163209		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年3月29日		
报告期末基金份额总额	19,037,922.23份		
投资目标	本基金实施被动式投资,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力图实现指数投资偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。		
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在中证创业成长指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证创业成长指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证创业成长指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。		
业绩比较基准	95%×中证创业成长指数收益率+5%×金融同业存款利率		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额看,诺安稳健份额具有低风险、收益相对稳定的特征;诺安进取份额具有高风险、高预期收益的特征。		
基金管理人	诺安基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
下属分级基金场内简称	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
下属分级基金的交易代码	163209	150073	150075
报告期末下属分级基金的份额总额	13,998,117.23份	2,015,922.00份	3,023,883.00份
下属分级基金的风险收益特征	较高风险、较高预期收益。	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益。

注:本基金上市交易的证券交易所为深圳证券交易所,下属分级基金的基金简称、交易代码均为在深圳证券交易所上市交易的简称及交易代码。

§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	-244,617.19
2.本期利润	2,749,595.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.1236
4.期末基金资产净值	14,263,131.90
5.期末基金份额净值	0.749

注:①上述基金业绩指标不包括持有人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。

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。

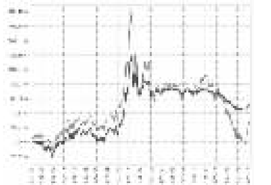
3.2 基金净值表现

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	25.45%	1.60%	25.27%	1.71%	0.18%	-0.11%

注:本基金业绩比较基准:95%×中证创业成长指数收益率+5%×金融同业存款利率。

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



注:本基金的建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
梅律吾	本基金基金经理	2012年7月28日	-	21	硕士,具有基金从业资格。曾任职于长城证券公司、鹏华基金管理有限公司;2005年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理、研究部副总监,现任指数组负责人。曾于2007年11月至2009年10月担任诺安价值增长混合型证券投资基金基金经理,2009年3月至2010年10月担任诺安成长混合型证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月担任诺安全球黄金证券投资基金基金经理,2011年9月至2012年11月任诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)基金经理,2017年8月至2017年10月任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2017年8月至2018年8月任诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2015年6月至2019年1月任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2012年7月起任诺安中证100指数证券投资基金及诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2014年2月起担任诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2017年8月起担任上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年8月起任诺安沪深300指数增强型证券投资基金基金经理,2019年1月起任诺安中证500指数增强型证券投资基金基金经理。
李玉良	本基金基金经理	2015年3月7日	-	15	博士,曾任职于中国工商银行股份有限公司,从事内部风险管理及稽核工作。2010年6月加入诺安基金管理有限公司,历任产品经理、基金经理助理。2015年3月起任诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金经理,2015年7月起任诺安多策略混合型证券投资基金基金经理,2016年3月起任诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年9月起任诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2018年7月起任诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安中证创业成长指数分级证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人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超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,主要原因在于投资组合采用不同的投资策略。经检查未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度全球股市普遍回暖。利好因素比较多,最主要原因在于各国央行纷纷转向鸽派。美联储在一季度停止了加息进程,同时明确表态9月份停止缩表。其他各国央行也都转向宽松货币政策。中美贸易战缓和也是重要的利好因素。这两大利好显著提升了全球投资者2019年的风险偏好。由此导致全球股市普涨。

中国A股一季度表现较好。这也容易解释。中国央行早在2018下半年就开始转向宽松货币政策。"宽货币"在2019年转化为"宽信用",从而有力支持了实体经济。此外中国政府还推行积极的财政政策,2018下半年就启动了"新基建",扩大了基建投资。此外2019年减免税费高达2万亿元。宽松货币与积极财政"双管齐下"。稳增长的效果逐渐显现。中国经济在2019一季度逐渐企稳。这是A股市场最大的利好,也是全球其他股市所不具备的。从这个角度来看,A股领涨是理所当然的。

A股市场一季度虽然普涨,但是略有分化,小盘成长风格占优。创业板指数涨幅显著大于上证50指数。其主要原因在于,以创业板为代表的小盘成长股经历了三年漫长的熊市,因此估值修复动力最为强劲。此外2019一季度市场无风险利率仍处于低位,有利于小盘成长股提高估值水平。

中证创业成长指数是小盘成长股的典型代表,一季度涨幅超过25%。本基金完全复制中证创业成长指数,严格控制跟踪误差。因此分享了该指数上涨带来的收益,从而为基金持有人创造了比较满意的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.749元。本报告期基金份额净值增长率为25.45%,同期业绩比较基准收益率为25.27%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金在2019年1月2日至2019年3月29日期间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。

§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	12,578,901.59	35.93
	其中:股票	12,578,901.59	35.93
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	22,422,975.62	64.05
8	其他资产	4,874.58	0.01
9	合计	35,006,751.79	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	328,996.00	2.31
C	制造业	8,688,373.27	60.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	338,904.00	2.38
E	建筑业	395,140.85	2.77
F	批发和零售业	406,081.51	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	655,213.00	4.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	304,728.00	2.14
J	金融业	218,382.00	1.53
K	房地产业	81,963.00	0.57
L	租赁和商务服务业	360,963.00	2.53
M	科学研究和技术服务业	130,632.00	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	285,709.00	2.00
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	377,507.00	2.65
S	综合	-	-
	合计	12,572,592.63	88.15

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,308.96	0.04
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	6,308.96	0.04

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

5.3.1 报告期末指数投资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	300122	智飞生物	10,551	539,156.10	3.78
2	002466	天齐锂业	14,357	504,792.12	3.54
3	300136	信维通信	17,206	495,876.92	3.48
4	002460	赣锋锂业	16,872	465,498.48	3.26
5	300601	康泰生物	6,941	393,554.70	2.76
6	002352	顺丰控股	10,550	386,341.00	2.71
7	300450	先导智能	9,715	361,300.85	2.53
8	002001	新和成	19,300	356,664.00	2.50
9	300176	派生科技	6,650	349,125.00	2.45
10	002127	南极电商	27,700	317,165.00	2.22

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002323	*ST百特	4,816	6,308.96	0.04

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投资贵金属。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定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	556.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,804.00
5	应收申购款	1,514.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,874.58

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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	300176	派生科技	349,125.00	2.45	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	002323	*ST百特	6,308.96	0.04	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	诺安中创	诺安稳健	诺安进取
报告期期初基金份额总额	14,765,179.84	1,901,822.00	2,852,733.00
报告期期间基金总申购份额	29,302,772.74	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	30,452,610.89	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	382,775.54	114,100.00	171,150.00
报告期期末基金份额总额	13,998,117.23	2,015,922.00	3,023,883.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算份额变动。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019.03.28	-	18,074,024.00	18,074,024.00	-	0.00%
个人	1	2019.03.28	-	16,728,129.00	16,728,129.00	-	0.00%
	2	2019.03.22-2019.03.29	-	13,457,604.31	13,457,604.31	-	0.00%
产品特有风险							
本报告期内,本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,敬请投资者留意可能由此产生的包括但不限于大额赎回可能引发的净值波动风险、基金流动性风险等风险事项。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2019年3月26日在《中国证券报》披露了《诺安基金管理有限公司关于以现场开会方式召开诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,本基金将于4月25日以现场开会方式召开基金份额持有人大会,审议《关于诺安中证创业成长指数分级证券投资基金转型有关事宜的议案》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

①中国证券监督管理委员会批准诺安中证创业成长指数分级证券投资基金募集的文件。

②《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金基金合同》。

③《诺安中证创业成长指数分级证券投资基金托管协议》。

④基金管理人业务资格批件、营业执照。

⑤诺安中证创业成长指数分级证券投资基金2019年第一季度报告正文。

⑥报告期内诺安中证创业成长指数分级证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话:400-888-8998,亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2019年4月19日

申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十九日

§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16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	申万菱信安泰惠利纯债券	
基金主代码	005936	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年8月16日	
报告期末基金份额总额	228,603,752.75份	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,努力追求基金资产的长期稳健增值,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金以中长期利率趋势分析为基础,结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,在严格控制流动性风险和信用风险等风险的基础上,实施积极的债券投资组合管理,以期获取较高的债券组合投资收益。	
业绩比较基准	业绩比较基准为:中国债券总指数(全价)收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票型及混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	安泰惠利纯债A	安泰惠利纯债C
下属分级基金的交易代码	005936	005990
报告期末下属分级基金的份额总额	198,520,742.09份	30,083,010.66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1月1日-2019年3月31日)	
	安泰惠利纯债A	安泰惠利纯债C
1.本期已实现收益	7,108,457.65	1,979,130.05
2.本期利润	2,877,115.71	1,237,708.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0170
4.期末基金资产净值	207,372,695.06	31,415,037.84
5.期末基金份额净值	1.0446	1.0443

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)上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用,但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等),计入认购或交易基金各项费用后,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

1、安泰惠利纯债A:

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	1.08%	0.06%	0.15%	0.08%	0.93%	-0.02%

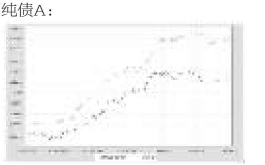
2、安泰惠利纯债C:

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	1.10%	0.06%	0.15%	0.08%	0.95%	-0.02%

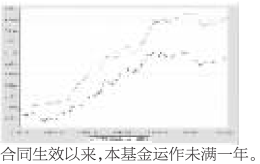
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年8月16日至2019年3月31日)

1. 安泰惠利纯债A:



2. 安泰惠利纯债C:



注:1)自基金合同生效以来,本基金运作未满一年。

2)本基金已在建仓期结束时,使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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		
叶瑜珍	本基金基金经理	2018-08-16	-	14年	叶瑜珍女士,硕士研究生。2005年1月加入申万菱信基金管理有限公司,曾任风险分析师、信用分析师、基金经理助理,申万菱信添益宝债券型证券投资基金基金经理,现任申万菱信可转换债券债券型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金、申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金、申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金基金经理。
唐俊杰	固定收益投资部总监、本基金基金经理	2019-01-25	-	10年	唐俊杰先生,硕士研究生。2008年起从事金融相关工作,曾任金元证券固定收益总部投资经理、万家基金固定收益部基金经理、总监。2017年10月加入申万菱信基金,现任固定收益投资部总监,申万菱信多策略灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信安鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.本报告期内,公司聘任唐俊杰先生担任本基金基金经理,具体见本基金管理人的相关公告。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定,严格遵守基金合同约定,本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定,信息披露及时、准确、完整;本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中,无任何损害基金持有人利益的行为,并通过稳健经营、规范运作、规避风险,保护了基金持有人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《公平交易办法》,通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务(包括研究分析、投资决策、交易执行等)环节中的实现,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,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;同时,通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在投资和研究方面,本公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程,提高投资决策的科学性和客观性,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境。

在交易执行方面,本公司的投资管理职能和交易执行职能相隔离,通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在日常监控和事后分析评估方面,本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。风险管理部通过对不同组合之间同向交易的价差率的假设检验、价格占优的次数百分比统计、价差交易模拟贡献与组合收益率差异的比较等方法对本报告期以及连续四个季度期间内、不同时间窗口下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析;对于场外交易,还特别对比了组合之间发生的同向交易的市场公允价格和交易对手,判断交易是否公平且是否涉及利益输送。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估,严格执行了公平交易制度,公平对待了旗下各投资组合。本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》,明确定义了在投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型,并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内,本公司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超过该证券当日成交量的5%的情况有1次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度以来,中国经济形势整体依然较为疲软,消费和投资增速持续下降,长期下行压力仍存。但是在积极的货币政策以及财政政策的共同作用下,部分经济数据和金融数据出现了企稳回升的迹象,市场对于经济形势的悲观预期出现了一定程度的修正。中美贸易摩擦也出现了缓和,双方进入积极谈判阶段,对市场偏好有着明显的提振作用。一季度油价和国内大宗商品出现小幅回升,但通胀水平维持温和。货币政策延续宽松态势,市场流动性较为宽裕,资金成本维持低廉。

国内债券市场经过去年的大幅上涨后,今年一季度收益率呈现出震荡走势。全季度来看,10年期国债收益率基本维持窄幅震荡;10年期政策性金融债收益率先小幅下行,此后震荡走高,季末较年初上行约10BP到20BP。信用债方面,高等级信用债同样呈现先抑后扬走势,整体表现较为平淡。低等级信用债风险暴露依然较多。

报告期内,本基金管理人积极动态调整资产配置结构,债券方面重点配置中短期限的利率债以及高等级信用债,并且在债券收益率下行至较低位置时及时降低了组合的仓位以及久期,有效地防范了信用风险,取得了较好的投资收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金A类产品报告期内净值表现为1.08%,同期业绩比较基准表现为0.15%。

本基金C类产品报告期内净值表现为1.10%,同期业绩比较基准表现为0.15%。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	213,614,000.00	88.70
	其中:债券	213,614,000.00	88.70
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	18,000,000.00	7.47
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,928,231.44	2.05
7	其他各项资产	4,287,000.75	1.78
8	合计	240,829,232.19	100.00

注:本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,807,000.00	30.07
	其中:政策性金融债	71,807,000.00	30.07
4	企业债券	40,569,000.00	16.99
5	企业短期融资券	70,139,000.00	29.37
6	中期票据	31,099,000.00	13.02
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	213,614,000.00	89.46

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	180406	18农发06	300,000.00	31,785,000.00	13.31
2	143259	18闽能02	200,000.00	20,310,000.00	8.51
3	180410	18农发10	200,000.00	20,016,000.00	8.38
4	160415	16农发15	200,000.00	20,006,000.00	8.38
5	101754036	17中航工MTN001	100,000.00	10,391,000.00	4.35

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同,本基金不得参与股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,166.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,086,349.48
5	应收申购款	191,484.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,287,000.75

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	安泰惠利纯债A	安泰惠利纯债C
本报告期期初基金份额总额	252,621,841.61	118,851,854.48
报告期基金总申购份额	68,978,464.14	61,964,104.97
减:报告期基金总赎回份额	123,079,563.66	150,732,948.79
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	198,520,742.09	30,083,010.66

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

基金合同;

招募说明书及其定期更新;

发售公告;

成立公告;

开放日常交易业务公告;

定期报告;

其他临时公告。

8.2存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所;开放日常交易业务公告、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为:中国上海市中山南路100号11层。

8.3查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅,也可在本基金管理人的网站进行查阅,查询网址:www.swsmu.com。

申万菱信基金管理有限公司
二〇一九年四月十九日