

国寿安保安盛纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第一季度报告

极,政策效果也将通过经济数据和金融数据逐步体现。

2019年货币市场仍延续宽松的局面,政府明确规定,M2和社会融资规模增速要与国内生产总值名义增速相匹配,以更好满足经济运行保持在合理区间的需要。社融增速的合理区间基本确定,货币条件持续改善将大概率事件,债券收益率在一季度内呈现先抑后扬走势,受内外部因素影响,经济放缓速度好于预期,回购利率和债券收益率中枢位置震荡震荡。同时,市场开始向利率收益,中等级别信用利差开始走强。

展望2019年二季度,大类资产呈现出较为明显的分化趋势,债券收益率相对明显,信用利差受到下行压力有所下降,预计仍将处在相对低位震荡。

本基金在操作上将通过组合久期,提高组合杠杠,保持静态收益率。并适度

参与利差做波段操作。

4.5 报告期末基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金份额净值为1.0448元;本报告期基金份额净值增长率为1.84%,业绩比较基准收益率为0.47%。

4.6 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 - -

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 5,162,002,300.00 97.98

其中:债券 4,812,794,000.00 90.91

资产支持证券 369,296,300.00 6.98

4 货币市场工具 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 其他资产 - -

其中:买入返售金融资产 - -

7 银行存款和结算备付金合计 27,702,968.18 0.02

8 其他资产 84,318,821.09 1.59

9 合计 5,269,114,000.00 100.00

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

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股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.2.3 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。

5.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 511,129.07

2 应收证券清算款 - -

3 应收股利 - -

4 应收利息 83,897,692.02

5 应收申购款 - -

6 其他应收款 - -

7 待摊费用 - -

8 其他 - -

9 合计 84,318,821.09

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 国债 - -

2 央行票据 - -

3 金融债 200,040,000.00 6.14

其中:政策性金融债 200,040,000.00 6.14

4 企业债 3,132,694,000.00 80.51

5 企业短期融资券 - -

6 中期票据 1,383,336,000.00 36.55

7 可转债(可交换债) - -

8 同业存单 96,725,000.00 2.49

9 其他 - -

10 合计 4,812,794,000.00 123.69

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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十名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 投资组合报告

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期末本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情况的说明

基金经理的买入、卖出证券的情况说明

基金经理的买入、卖出股票的情况说明

5.10.3 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 7,494.91

2 应收证券清算款 - -

3 应收股利 - -

4 应收利息 3,092,288.14

5 应收申购款 5,092.15

6 其他应收款 - -

7 待摊费用 - -

8 其他 - -

9 合计 3,104,864.00

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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 开放式基金份额变动

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。

6.2 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.3 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

6.4 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指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

6.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

6.6 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

6.7 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.1 基金管理人持有的基本份额明细

序号 证券代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 139346 中国银行A 1,100,000 110,389,000.00 2.84

2 139340 银行B601 750,000 76,315,000.00 1.94

3 166628 荣茂B02 600,000 60,160,000.00 1.56

4 139191 万科A7A1 430,000 43,176,000.00 1.11

5 139453 万科B7A1 400,000 40,136,000.00 1.03

6 139069 银行B7A1 400,000 40,000,000.00 1.03

7 1722010 17银行B02 1,900,000 192,185,000.00 4.94

8 172201 17银行B01 1,700,000 171,581,000.00 4.41

6.8 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。

6.9 报告期内投资者持有的基本份额变动情况

7.1 基金管理人持有的基本份额明细

序号 证券代码 证券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

10,000,450,000 10,000,450,000 100.00

6.10 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.2 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.3 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.4 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.5 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.6 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.7 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.8 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.9 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.10 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.11 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.12 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.13 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.14 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.15 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.16 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.17 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.18 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.19 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.20 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.21 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.22 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.23 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.24 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.25 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.26 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.27 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.28 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.29 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.30 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.31 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.32 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.33 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.34 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.35 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.36 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.37 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.38 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.39 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.40 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.41 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.42 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.43 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况

7.44 基金管理人运用资金投资基本份额变动情况