

国寿安保新金宝货币市场基金

2019年第一季度报告

定,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关于投资范围和投资限制的有关规定。本基金在合同期末时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为2019年11月20日至2019年3月31日。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介					
姓名	职务	在本基金的基金经理任期		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李俊	基金经理	2014年11月20日	17年	17年	硕士研究生,2002年7月毕业于中国人民大学,获金融学硕士学位,曾任交通银行2004年11月至2006年11月,任资产管理部资产管理部副经理,2006年12月至2013年12月,任平安资产管理,历任平安资产管理,2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司,担任国寿安保新金宝货币市场基金、国寿安保新鑫货币市场基金、国寿安保新鑫货币市场基金、国寿安保新鑫货币市场基金、国寿安保新鑫货币市场基金基金经理。

注:任职日期为基金合同生效日,证券从业含义遵照行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保新金宝货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

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资产造成损失的异常交易行为;且不存在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多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2019年1季度国内货币政策整体保持合理宽松,在信贷投放的支撑下央行货币政策操作更加具有前瞻性,通过前期调节货币与信贷确保货币市场流动性稳定。此外,美国国债收益率曲线出现倒挂,根据历史经验美国出现收益率曲线倒挂往往预示着经济衰退的兆头,考虑到全球宏观经济未来长期面临不确定性以及国内宏观经济较为稳健,央行进一步降低利率存在压力,如果持续推低市场利率,未来一旦宏观经济增长的步入衰退我国货币政策可能进入入降无可降的局面,由此不排除未来央行近期选择维持住货币市场利率水平等待外部情况明朗化。从市场利率看,1季度货币市场利率维持低位窄幅震荡,1季度银行间市场性的7日质押式回购加权利率均价2.66%。在资金宽松、货币政策稳健的背景下,1季度货币存单发行利率总体维持平稳,3个月期限AAA级存单整体利率平均在2.6-2.80%附近,仅季度末前资金影响波动增大,货币市场曲线整体呈扁平化,期限利差受到较大程度压缩。

1季度,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,结合本基金以零售客户为主的特征,以确保组合流动性、安全性为重要任务,适度调整债券投资组合,管理现金流,保障组合充足流动性。本基金成功应对了市场和规模的波动,投资业绩平稳,实现了均衡安全性、流动性和收益性的目标,组合的持仓结构、流动性弹性良好,为下一阶段抓住市场机遇,创造安全收益打下了良好基础。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期基金份额净值增长率为0.7227%,业绩比较基准收益率为0.3229%。

2019年第一季度报告

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	固定收益投资	14,674,643,928.75	99.19
	其中:债券	14,674,643,928.75	99.19
2	买入返售金融资产	1,166,722,708.58	3.11
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	21,467,012,920.07	57.34
4	其他资产	133,623,230.62	0.36
5	合计	37,441,002,800.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末按行业分类的股票投资组合	13.53
	其中:买入返售金融资产	-

注:本基金报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期末每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
本基金本报告期末债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 投资组合平均剩余期限

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	112
报告期末投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期末投资组合平均剩余期限最低值	100

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	0天以内	27.14	0.06
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天<=90天	14.62	0.03
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	90天<=180天	15.63	0.03
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	180天<=270天	0.68	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	270天<=397天(含)	50.81	0.09
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	108.68	0.08

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名资产支持证券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益类投资	297,919,098.42	93.18
	其中:股票	297,919,098.42	93.18

注:本基金基金合同生效日为2015年9月1日,按照本基金的基金合同约定,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关于投资范围和投资限制的有关规定。本基金在合同期末时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为2015年9月1日至2015年3月31日。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	在本基金的基金经理任期		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李俊	基金经理	2015年9月1日	14年	14年	2006年1月至2015年6月,在任国寿安保基金管理有限公司资产管理部副经理,基金运营部副经理,基金经理助理,基金经理助理,2015年6月加入国寿安保基金管理有限公司,担任国寿安保新鑫货币市场基金、国寿安保新鑫货币市场基金、国寿安保新鑫货币市场基金、国寿安保新鑫货币市场基金、国寿安保新鑫货币市场基金基金经理。

注:任职日期为基金管理人对外披露的任职日期,证券从业含义遵照行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保智慧生活股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

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资产造成损失的异常交易行为;且不存在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多的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
1、市场回顾
一季度,国内A股市场出现了单边上行的趋势,上证综指上涨23.93%,沪深300上涨28.62%,中证100上涨26.43%,创业板指上涨35.43%。一级行业全部收

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	297,919,098.42	93.18
	其中:股票	297,919,098.42	93.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	20,990,136.39	6.79
6	银行存款和结算备付金合计	72,165,277.02	22.87
9	合计	308,961,388.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	5,682,376.00	1.84
B	医药	-	-
C	制造业	243,980,283.33	79.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,375.14	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,612,640.00	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	7,740,815.63	2.51
H	信息传输、软件和信息技术服务业	16,042,629.94	5.21
I	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,668,287.64	2.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,365,749.84	0.44
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	287,919,098.42	93.42

5.3 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	固定收益投资	208,111,962.88	99.26
	其中:债券	208,111,962.88	99.26
2	买入返售金融资产	-	-
3	应收收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	金融资产投资	-	-
	其中: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	1,552,002.58	0.74
8	其他资产	8,429.91	0.00
9	合计	209,672,065.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,022,927.00	0.97
B	医药	6,020,106.67	2.89
C	制造业	116,321,410.88	56.01
N	水利、环境和公共设施管理业	6,113,509.00	2.92
E	建筑业	3,679,990.03	1.76
F	批发和零售业	10,791,219.97	5.06
G	交通运输、仓储和邮政业	7,981,159.76	3.88
H	信息传输、软件和信息技术服务业	20,623,473.14	9.88
I	金融业	7,703,469.92	3.69
K	房地产业	11,866,398.62	5.67
L	租赁和商务服务业	3,244,227.81	1.56
M	科学研究和技术服务业	346,150.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,316,420.50	0.63
Q	教育	158,006.40	0.08
Q	卫生和社会工作	1,522,296.40	0.73
R	文化、体育和娱乐业	5,262,664.96	2.51
S	综合	2,963,770.00	1.42
	合计	208,111,962.88	99.42

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未投资港股通股票。

5.3 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)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益类投资	208,111,962.88	99.26
	其中:股票	208,111,962.88	99.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	金融资产投资	-	-
	其中: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	1,552,002.58	0.74
8	其他资产	8,429.91	0.00
9	合计	209,672,065.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,022,927.00	0.97
B	医药	6,020,106.67	2.89
C	制造业	116,321,410.88	56.01
N	水利、环境和公共设施管理业	6,113,509.00	2.92
E	建筑业	3,679,990.03	1.76
F	批发和零售业	10,791,219.97	5.06
G	交通运输、仓储和邮政业	7,981,159.76	3.88
H	信息传输、软件和信息技术服务业	20,623,473.14	9.88
I	金融业	7,703,469.92	3.69
K	房地产业	11,866,398.62	5.67
L	租赁和商务服务业	3,244,227.81	1.56
M	科学研究和技术服务业	346,150.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,316,420.50	0.63
Q	教育	158,006.40	0.08
Q	卫生和社会工作	1,522,296.40	0.73
R	文化、体育和娱乐业	5,262,664.96	2.51
S	综合	2,963,770.00	1.42
	合计	208,111,962.88	99.42

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未投资港股通股票。

5.3 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)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益类投资	208,111,962.88	99.26
	其中:股票	208,111,962.88	99.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	金融资产投资	-	-
	其中: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	1,552,002.58	0.74
8	其他资产	8,429.91	0.00
9	合计	209,672,065.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,022,927.00	0.97
B	医药	6,020,106.67	2.89
C	制造业	116,321,410.88	56.01
N	水利、环境和公共设施管理业	6,113,509.00	2.92
E	建筑业	3,679,990.03	1.76
F	批发和零售业	10,791,219.97	5.06
G	交通运输、仓储和邮政业	7,981,159.76	3.88
H	信息传输、软件和信息技术服务业	20,623,473.14	9.88
I	金融业	7,703,469.92	3.69
K	房地产业	11,866,398.62	5.67
L	租赁和商务服务业	3,244,227.81	1.56
M	科学研究和技术服务业	346,150.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,316,420.50	0.63
Q	教育	158,006.40	0.08
Q	卫生和社会工作	1,522,296.40	0.73
R	文化、体育和娱乐业	5,262,664.96	2.51
S	综合	2,963,770.00	1.42
	合计	208,111,962.88	99.42

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未投资港股通股票。

5.3 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)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益类投资	208,111,962.88	99.26
	其中:股票	208,111,962.88	99.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	金融资产投资	-	-
	其中: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	1,552,002.58	0.74
8	其他资产	8,429.91	0.00
9	合计	209,672,065.45	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,022,927.00	0.97
B	医药	6,020,106.67	2.89
C	制造业	116,321,410.88	56.01
N			