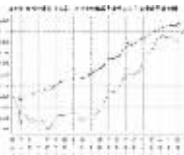


农银汇理金穗纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告



中期动态配置上,我们更加看好债券类资产、低风险资产。
4.5 报告期内基金的投资业绩和净值报告期内基金净值增长率为0.54%,业绩比较基准收益率为0.63%。
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,本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内,本基金未出现上述情形。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	基金投资	-	-
3.1	固定收益投资	68,741,419.00000	88.27
3.2	其中:债券	68,741,419.00000	88.27
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	5,400,000.00000	7.01
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7.1	银行存拆放款项合计	1,630,321,191.41	2.12
8	其他资产	1,232,281,680.01	1.60
9	合计	77,004,021,080.42	100.00

5.1 报告期末基金资产组合情况
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
5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
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
5.4 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	地方政府债	-	-
3	金融债券	60,749,089.00000	78.92
3.1	其中:政策性金融债	68,302,412.00000	75.74
4	企业债券	263,680,000.00000	0.33
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	1,508,264,000.00000	2.08
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	待偿还资产支持证券	6,140,380,000.00000	7.98
9	其他	-	-
10	合计	68,741,419.00000	88.30

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

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贵金属投资明细

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

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贵金属投资明细

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.10 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.11 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.12 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.13 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.14 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.15 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.16 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.17 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.18 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.19 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.20 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.21 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.22 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.23 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

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	180225	18国债15	52,500,000	5,252,100,000.00	6.82
2	180035	18国债11	40,400,000	4,046,080,000.00	5.26
3	150003	15国债10	32,800,000	3,301,320,000.00	4.29
4	120312	12国债12	29,060,000	2,911,391,000.00	3.78
5	000028	08国债08	26,900,000	2,589,482,000.00	3.38

5.24 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

以互联网化为代表的成长股。

4.5 报告期内基金的业绩表现