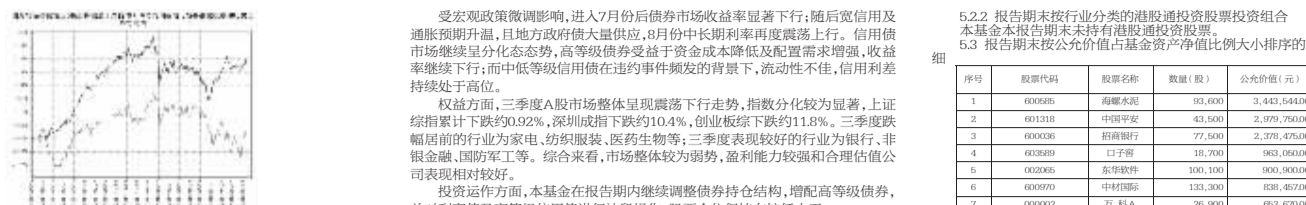


国寿安保稳信混合型证券投资基金

2018年第三季度报告



受宏观政策调整影响,进入7月份后债券市场收益率显著下行,随后信用债及通债利率分化,且地方政府债大量供应,8月中旬长期利率再度爬高上行,信用债市场继续呈现分化态势,高等级债券受益于资金成本降低及配置需求增加,收益率先持续下行;而中低等级信用债在违约事件频发的背景下,流动性不佳,信用利差持续处于高位。

权益方面,三季度A股市场整体呈现震荡下行走势,指数分化较为显著,上证指数综算下跌约0.92%,深圳成指下跌约10.4%,创业板综下跌约11.8%。三季度涨幅居前行业为家电、纺织服装、医药生物等;三季度表现较好的行业为银行、非银金融、国防军工等。综合来看,市场整体较为弱势,盈利能力较强和合理估值公司表现相对较好。

投资运作方面,本基金在报告期内继续调整持仓结构,增配高等级债券,并对利率债及高等级信用债进行波段操作,股票仓位保持在较低水平。

报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末国寿安保稳信混合A基金份额净值为1.0129元,本报告期基金份额净值增长率为1.74%,截至本报告期末国寿安保稳信混合C基金份额净值为1.0115元,本报告期基金份额净值增长率为1.72%,同期业绩比较基准收益率为0.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	13,412,270.00	62.6
2	其中:股票	13,412,270.00	62.6
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	236,336,460.00	92.26
5	其中:债券	236,336,460.00	92.26
6	货币市场基金	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	其他	-	-
10	合计	250,000,230.00	100.0

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	医药	4,280,000.00	1.86
C	制造业	146,475,613.64	68.30
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	采掘业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,986,000.00	0.93
H	信息技术业	14,562,300.00	6.69
I	房地产业	1,086,000.00	0.51
J	金融业	1,452,000.00	0.69
K	租赁和商务服务业	2,041,500.00	0.95
L	科学研究和技术服务业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	文化、体育和娱乐业	-	-
O	综合	177,871,114.22	82.84

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

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	000958	五粮液	146,000	6,920,700.00	4.65
2	000077	华谊兄弟	371,300	6,385,360.00	4.00
3	002649	口子窖	124,500	6,286,200.00	2.98
4	002203	梦天生活	666,205	6,245,104.22	2.91
5	002228	联华电子	111,000	6,036,180.00	2.91
6	002807	润兴装备	222,000	5,783,100.00	2.85
7	002643	盛通股份	469,557	5,236,200.00	2.42
8	000008	神州高铁	226,200	6,286,760.00	2.42
9	000000	浦发银行	5,122,200.00	2,319,000.00	1.12
10	000000	浦发银行	112,000	5,107,200.00	2.38

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	国债投资	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,044,000.00	4.69
4	其中:政策性金融债	10,044,000.00	4.69
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,044,000.00	4.69

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	180808	18国债08	200,000	20,206,000.00	10.44
2	130625	13国债05	125,000	11,984,400.00	6.19
3	181926	18国债19	100,000	10,469,000.00	5.41
4	000007	浦发银行07债	100,000	6,286,760.00	3.10
5	10180007	17国债07附息01	100,000	10,138,000.00	5.28

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

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五名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.13 其他资产构成

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	000958	五粮液	146,000	6,920,700.00	4.65
2	000077	华谊兄弟	371,300	6,385,360.00	4.00
3	002649	口子窖	124,500	6,286,200.00	2.98
4	002203	梦天生活	666,205	6,245,104.22	2.91
5	002228	联华电子	111,000	6,036,180.00	2.91
6	002807	润兴装备	222,000	5,783,100.00	2.85
7	002643	盛通股份	469,557	5,236,200.00	2.42
8	000008	神州高铁	226,200	6,286,760.00	2.42
9	000000	浦发银行	5,122,200.00	2,319,000.00	1.12
10	000000	浦发银行	112,000	5,107,200.00	2.38

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五名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债投资	204,697,560.00	100.0
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,044,000.00	4.69
4	其中:政策性金融债	10,044,000.00	4.69
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	-	-
9	其他	-	-
10	合计	214,741,560.00	100.0

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五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

本基金本报告期末持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末持有权证。

5.19 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.20 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.21 投资组合报告附注

5.21.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

5.21.2 基金投资前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.21.3 其他资产构成

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	000958	五粮液	146,000	6,920,700.00	4.65
2	000077	华谊兄弟	371,300	6,385,360.00	4.00
3	002649	口子窖	124,500	6,286,200.00	2.98
4	002203	梦天生活	666,205	6,245,104.22	2.91
5	002228	联华电子	111,000	6,036,180.00	2.91
6	002807	润兴装备	222,000	5,783,100.00	2.85
7	002643	盛通股份	469,557	5,236,200.00	2.42
8	000008	神州高铁	226,200	6,286,760.00	2.42
9	000000	浦发银行	5,122,200.00	2,319,000.00	1.12
10	000000	浦发银行	112,000	5,107,200.00	2.38

5.23 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	国债投资	204,697,560.00	100.0
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,044,000.00	4.69
4	其中:政策性金融债	10,044,000.00	4.69
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	-	-
9	其他	-	-
10	合计	214,741,560.00	100.0

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	180808	18国债08	200,000	20,206,000.00	10.44
2	130625	13国债05	125,000	11,984,400.00	6.19
3	181926	18国债19	100,000	10,469,000.00	5.41
4	000007	浦发银行07债	100,000	6,286,760.00	3.10
5	10180007	17国债07附息01	100,000	10,138,000.00	5.28

5.25 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.26 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

本基金本报告期末持有贵金属。

5.27 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

本基金本报告期末持有权证。

5.28 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.29 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.30 投资组合报告附注

5.30.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

5.30.2 基金投资前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.30.3 其他资产构成

5.31 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

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	000958	五粮液	146,000	6,920,700.00	4.65
2	000077	华谊兄弟	371,300	6,385,360.00	4.00
3	002649	口子窖	124,500	6,286,200.00	2.98
4	002203	梦天生活	666,205	6,245,104.22	2.91
5	002228	联华电子	111,000	6,036,180.00	2.91
6	002807	润兴装备	222,000	5,783,100.00	2.85
7	002643	盛通股份	469,557	5,236,200.00	2.42
8	000008	神州高铁	226,200	6,286,760.00	2.42
9	000000	浦发银行	5,122,200.00	2,319,000.00	1.12
10	000000	浦发银行	112,000	5,107,200.00	2.38

5.32 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	国债投资	204,697,560.00	100.0
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,044,000.00	4.69
4	其中:政策性金融债	10,044,000.00	4.69
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	-	-
9	其他	-	-
10	合计	214,741,560.00	100.0

5.33 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	180808	18国债08	200,000	20,206,000.00	10.44
2	130625	13国债05	125,000	11,984,400.00	6.19
3	181926	18国债19	100,000	10,469,000.00	5.41
4	000007	浦发银行07债	100,000	6,286,760.00	3.10
5	10180007	17国债07附息01	100,000	10,138,000.00	5.28

5.34 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.35 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

本基金本报告期末持有贵金属。

5.36 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

本基金本报告期末持有权证。

5.37 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.38 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.39 投资组合报告附注

5.39.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

5.39.2 基金投资前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.39.3 其他资产构成

5.40 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

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	000958	五粮液	146,000	6,920,700.00	4.65
2	000077	华谊兄弟	371,300	6,385,360.00	4.00
3	002649	口子窖	124,500	6,286,200.00	2.98
4	002203	梦天生活	666,205	6,245,104.22	2.91
5	002228	联华电子	111,000	6,036,180.00	2.91
6	002807	润兴装备	222,000	5,783,100.00	2.85
7	002643	盛通股份	469,557	5,236,200.00	2.42
8	000008	神州高铁	226,200	6,286,760.00	2.42
9	000000	浦发银行	5,122,200.00	2,319,000.00	1.12
10	000000	浦发银行	112,000	5,107,200.00	2.38

5.41 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	国债投资	204,697,560.00	100.0
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,044,000.00	4.69
4	其中:政策性金融债	10,044,000.00	4.69
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债(可交换债)	-	-
9	其他	-	-
10	合计	214,741,560.00	100.0

5.42 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