

华安安浦债券型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31
基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期：2019-04-20

重要提示

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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失，或保证收益最低限。投资者投资于本基金，可能会面临本金亏损或收益波动的风险。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Rows include 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属2级基金的名称, 下属2级基金的交易代码, 报告期末下属2级基金的资产总额, 报告期末下属2级基金的风险收益特征.

主要财务指标

Table with 4 columns: 主要财务指标, 本基金(元), 华安安浦债券A(C) 2019-01-01 - 2019-03-31, 华安安浦债券C(C) 2019-01-01 - 2019-03-31. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易费用，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平可能低于所列数字。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。

基金净值表现

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

Table with 6 columns: 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.

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

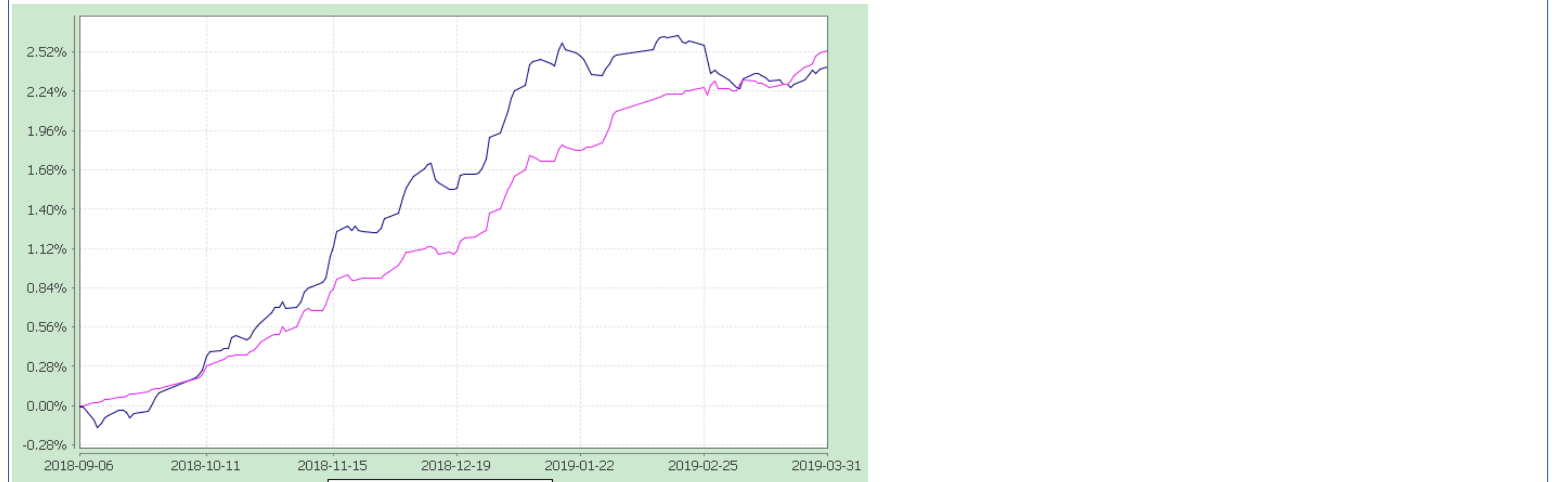
Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④.

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

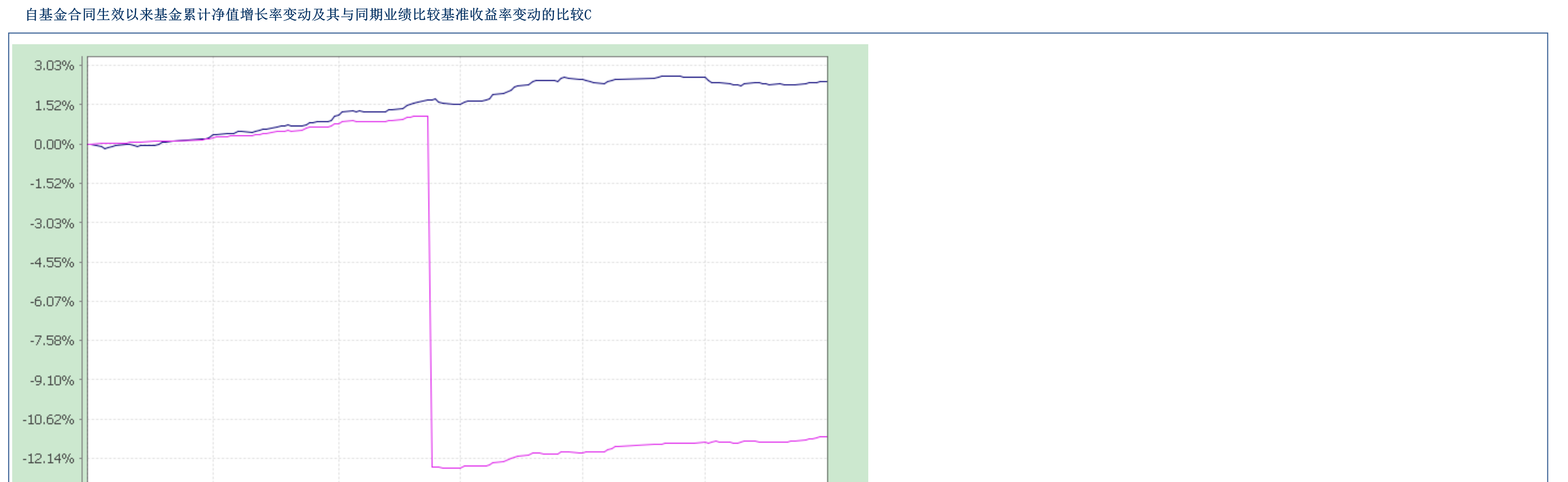
Table with 6 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④.

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变动的比较

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变动的比较



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变动的比较



其他指标

Table with 2 columns: 其他指标, 报告日期 (2019-01-01至2019-03-31). Rows include 基金管理人, 基金托管人.

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 6 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Rows include 孙丽娜.

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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《证券投资基金法》等相关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定资产管理业务及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理。

报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度，全球主要经济体增长乏力，国际贸易和投资活动有所承压，国内政策加力提效，社融增速企稳回升，宏观经济稳中趋稳，权益市场迎来估值修复，债市受市场风险偏好影响，收益水平有所上行。

报告期末基金的投资表现

截至2019年3月31日，华安安浦债券型证券投资基金的净资产为人民币4,018.3元，（含净值损失6,887.9元），华安安浦债券型证券投资基金的净值增长率为1.11%，（含净值损失为-1.09%，同期业绩比较基准增长0.47%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，随着稳增长政策持续跟进，宏观经济企稳可期，减税降税或带动制造业投资，消费政策刺激下存在企稳可能，出口超预期及通胀回升，信用风险溢价有所回落，通胀中枢二季度有望显著上行，宽货币的目的有望实现，达成长期货币仍将维持宽松，债市市场大概率维持震荡态势。

报告期末基金份额持有人户数或基金份额净值预警说明

本基金报告期内不存在基金份额持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益类投资, 固定收益投资, 资产支持证券, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其他资产.

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A 农、林、牧、渔业, B 采矿业, 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.

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 070299, 2 080208, 3 070607, 4 040203, 5 080202.

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国债债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 4 企业债券, 5 企业短期融资券, 6 中期票据, 7 可转债(可交换债), 8 同业存单, 9 其他, 10 合计.

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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 170299, 2 080208, 3 070607, 4 040203, 5 080202.

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 070299, 2 080208, 3 070607, 4 040203, 5 080202.

注：本基金本报告期末未持有资产支持投资。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险说明. Rows include 公允价值变动总额合计(元), 股指期货投资本期收益(元), 股指期货投资本期公允价值变动(元).

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

无。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码, 名称, 持仓量(买/卖), 合约市值(元), 公允价值变动(元), 风险损益说明. Rows include 公允价值变动总额合计(元), 国债期货投资本期收益(元), 国债期货投资本期公允价值变动(元).

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

无。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本报告期内，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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 其他, 9 合计.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

开放式基金份额变动

Table with 4 columns: 项目, 华安安浦债券, 华安安浦债券A, 华安安浦债券C. Rows include 报告期初基金份额总额, 报告期基金份额申购总额, 减：报告期基金份额赎回总额, 报告期末基金份额总额.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金基金份额变动情况

Table with 4 columns: 项目, 华安安浦债券, 华安安浦债券A, 华安安浦债券C. Rows include 报告期初管理人持有的基金份额, 报告期买入/卖出/赎回基金, 报告期末管理人持有的基金份额.

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易金额(份), 交易金额(元), 适用费率. Rows include 合计.

注：无。

报告期末发起资金发起持有份额情况

Table with 5 columns: 项目, 持有份额总数, 持有份额占基金总份额比例, 发起份额总数, 发起份额占基金总份额比例, 发起份额承诺持有期限. Rows include 基金管理人固有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金经理等人员, 基金管理人股东, 其他, 合计.

报告期内前十名投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 6 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过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. Rows include 个人, 机构.

本基金报告期内出现前十名投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，如单一投资者大额赎回可能导致基金份额波动加剧、基金流动性风险等特定风险。

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1、《华安安浦债券型证券投资基金基金合同》
2、《华安安浦债券型证券投资基金招募说明书》
3、《华安安浦债券型证券投资基金托管协议》
4、《华安安浦债券型证券投资基金托管协议》

存放地点

基金管理人及基金托管人的办公场所，并登录于基金管理人互联网网站http://www.huanan.com.cn。

查询方式

投资者可登录基金管理人网站查询，或在营业时间内向基金管理人或基金托管人的办公场所免费查询。