

华安安盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金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：浙商银行股份有限公司
报告送出日期：2019-04-20

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
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。
基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2019年1月25日起至3月31日止。
本报告自2019年1月25日起至3月31日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金名称 (华安安盛定开), 基金代码 (000336), 基金运作方式 (契约开放式), 基金合同生效日 (2019-01-25), 期末基金份额总额 (639,998,000.00), 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 (华安基金管理有限公司), 基金托管人 (浙商银行股份有限公司).

主要财务指标

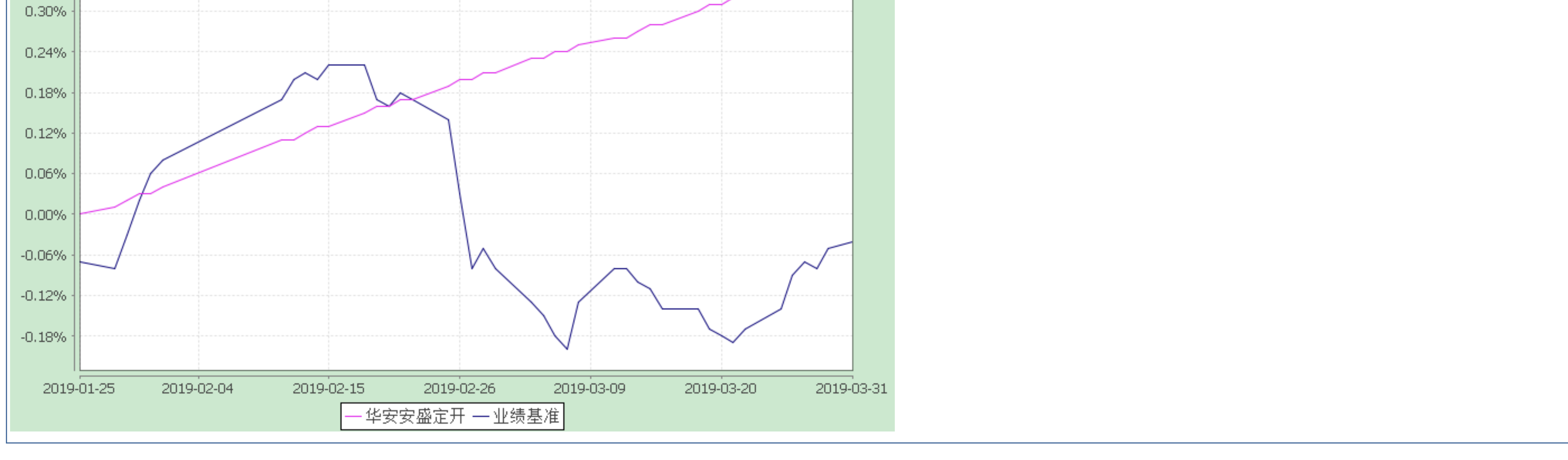
Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-01-25至2019-03-31). Includes 本期已实现收益 (2,578,928.17), 本期利润 (2,534,628.17), 加权平均基金份额本期利润 (0.00), 期末基金资产净值 (642,532,628.17), 期末基金份额净值 (1.0009).

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、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要低于所列数字。
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

Table with 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. Includes 过去三个月 (0.40%, 0.01%, -0.04%, 0.04%, 0.44%, -0.03%)

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率变动的比较
图例：— 华安安盛定开 — 业绩基准



注：1. 本基金于2019年1月25日成立，截止本报告期末，本基金成立未满一年。
2. 本基金为基金合同生效后6个月，基金管理人应当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的有关规定。

其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-01-25至2019-03-31). Includes 其他指标 (基金合同生效以来基金份额持有人户数变动情况).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Includes 贺涛 (本基金基金经理, 固定收益部总监, 2019-01-25, 21年), 周益鸣 (本基金基金经理, 2019-03-04, 10年).

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

管理人对于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》等有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，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

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》，对封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理及其他投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全面纳入公平交易管理体系。

异常交易行为的专项说明
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》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门共同制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所场内和场外的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的自动控制。同时加强了事前、事中、事后的监控与事后分析及稽核。风险管理部开发了同日反向交易监控系统，定期对同向交易数据进行分析，并定期向合同的相关方进行了重点分析。本报告期内，除货币基金以外的所有投资组合参与交易所公开竞价交易，出现同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量0.5%的次数为0次，未出现异常交易。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年上半年经济虽尚未显企稳，但随着社会融资增速的恢复以及中美贸易谈判的顺利进行，市场风险偏好显著提升，无风险利率出现了小幅的上行。在10年期收益率和上证50成分股接近后，大类资产配置发生了明显的转变，走出“股强债弱”的行情。尽管以美国为首的外海经济显现出明显的疲态，各项经济数据开始走弱，债券收益率开始阶段新低，但对国内的影响相对较小，目前左右我国金融资产走势的主要矛盾还是在于我国自身的经济变化。

报告期内基金的业绩表现

截至2019年3月31日，本基金份额净值为1.0009元，本报告期份额净值为0.40%，同期业绩比较基准增长率为-0.04%。

管理人宏观展望、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济面临企稳反弹，首先，我们认为社融仍会进一步扩张，无论是表内贷款还是表外的信托贷款、委托贷款等都有扩张的空间，其次，居民的中长期预期开始恢复增长，同时短期预期快速走出底部，说明居民的资产价值也在显著改善，中长期预期恢复意味着未来资产价格可能会全面回升，中长期预期快速走出底部意味着低估值修复压力缓解，消费有望恢复，然后，海外经济相对较弱，出口方面仍然有较大的压力，但国内因素相比并不构成很大的影响，综合来看，国内经济整体缓慢复苏，风险偏好有所进一步，股市有望进一步上行的空间，同时债券市场收益率也会因进一步的攀升。
本基金在二季度仍将仍以中长期债券作为主要配置品种，获取较为稳定的票息收入，尽量减少利率上行带来的影响。

报告期末基金持有人户数或基金份额净值预警说明

本基金为发起式证券投资基金，报告期内不存在基金份额净值低于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 columns: 序号, 项目, 金额 (元), 占基金总资产的比例 (%). Includes 权益类投资 (99,847,000.00), 固定收益投资 (69,847,000.00), 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计, 其他, 合计 (1,967,185.04).

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Lists various industry categories like 农林牧渔, 采矿业, 制造业, etc.

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 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 (%). Lists top 10 stocks by market value.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Lists various bond types like 国债, 央行票据, 金融债, etc.

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 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 (%). Lists top 5 bonds by market value.

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

Table with 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 (%).

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

Table with columns: 序号, 代码, 名称, 数量 (份), 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%).

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 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.

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险指标说明.

本基金投资股指期货的投资政策

本基金为发起式证券投资基金，本报告期不存在基金份额净值低于5000万元的情形。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金为发起式证券投资基金，本报告期不存在基金份额净值低于5000万元的情形。

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 columns: 代码, 名称, 持仓量 (买/卖), 合约市值 (元), 公允价值变动 (元), 风险指标说明.

本期国债期货投资评价

本基金为发起式证券投资基金，本报告期不存在基金份额净值低于5000万元的情形。

投资组合报告附注

受到调查及处罚情况
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 columns: 序号, 名称, 金额 (元). Lists other assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

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在流通受限情况的股票。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 数量. Includes 基金合同生效日的基金份额总额 (639,998,000.00), 基金合同生效日至报告期末基金总申购份额, 基金合同生效日至报告期末基金总赎回份额, 基金合同生效日至报告期末基金总申购份额, 基金合同生效日至报告期末基金总赎回份额, 报告期末基金份额总额 (639,998,000.00).

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份额变动情况
Table with columns: 项目, 基金份额. Includes 基金合同生效日管理人持有的基金份额, 基金合同生效日至报告期末基金买入/申购总额 (10,000,000.00), 基金合同生效日至报告期末基金卖出/赎回总额, 报告期末管理人持有的基金份额 (10,000,000.00), 报告期末管理人持有基金份额占基金份额总额比例 (%) (1.56%).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
Table with 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. Includes 1 (申购, 2019-01-22, 10,000,000.00, 10,001,000.00, 0.00%), 合计 (10,000,000.00, 10,001,000.00).

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 columns: 项目, 持有份额总额, 持有份额占基金资产净值比例, 公允价值总额, 公允价值占基金资产净值比例, 报告期末持有基金份额, 报告期末持有基金份额占比. Includes 基金管理人持有资产支持证券, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金经理等人员, 基金管理人股东, 其他, 合计 (10,000,000.00, 1.56%, 10,000,000.00, 1.56%, 三年).

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
Table with 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, 持有基金份额, 报告期末持有基金份额, 报告期末持有基金份额占比. Includes 机构 (20190128-20190331, 0.00, 0.00, 299,999,000.00, 299,999,000.00, 46.87%), 个人 (20190128-20190331, 328,999,000.00, 328,999,000.00, 328,999,000.00, 51.56%).

本基金报告期内未发现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形，如该单一投资者大额赎回可能导致基金份额净值波动风险、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. 《华安安盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
2. 《华安安盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
3. 《华安安盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》

存放地点

基金管理人和本基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网网站http://www.huawen.com.cn。

查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网网站，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。