

华安安逸半年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

基金管理人及基金托管人承诺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。
基金管理人承诺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。
基金管理人承诺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。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 华安安逸半年定期开 (Fund Name), 数值 (Value). Includes fields like 基金简称, 场内简称, 基金主代码, 基金运作方式, etc.

主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 报告期 (2019-01-01 至 2019-03-31) (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

基金净值表现

Table showing 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 (Comparison of fund net value growth rate and benchmark return).



其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (2019-01-01至2019-03-31) (Reporting Period), 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任职日期 (Start Date), 离任日期 (Resignation Date), 证券从业资格 (Securities Qualification), 说明 (Remarks).

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》，确定资产管理组合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。

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门会同基金运营、交易等部门持续制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间市场的同日反向交易控制机制，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系統控制。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度债券利率整体呈现震荡走势，一季度末10年期债、5年AAA中票利率分别比上年末下降了5bp、8bp，跨过年底后流动性非常宽松，带动各期限利率由现明显下行，各债券品种（尤其是利率债）利率也达到了今年到目前的最低点。

报告期内基金的业绩表现

截至2019年3月31日，华安安逸半年定期开放基金份额净值为1.0214元，本报告期份额净值增长率为0.13%，同期业绩比较基准增长率为0.47%。

管理人宏观展望、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，在全球经济增速整体回落、美国加息进程可能中止的环境下，国内央行预计仍将保持稳健中性的货币政策，二季度存在央行进行全面降准或定向降准的可能性，流动性将保持适度宽松。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式证券投资基金，报告期内不存在基金资产净值低于5000万元的情形。

投资组合报告

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(%)

Table of top 10 stock investments by fair value as a percentage of net asset 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十名债券投资明细

Table of top 10 bond investments by fair value as a percentage of net asset 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 of top 5 precious metal investments by fair value as a percentage of net asset 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权证投资明细

Table of top 5 warrant investments by fair value as a percentage of net asset value.

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table of open interest and P&L for futures contracts held at the end of the reporting period.

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table of open interest and P&L for Treasury futures contracts held at the end of the reporting period.

受调查对象及处罚情况

2018年11月19日，中信银行因违反现金管理规定、自有资金金融违规被银保监会《银保监会罚单》(2018)119号给予罚款2200万元的行政处罚。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票范围

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同约定的备选股票之外的股票。

其他资产构成

Table showing the composition of other assets, including 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in RMB Yuan).

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。

开放式基金业绩变动

Table showing performance changes for open-ended funds, including 项目 (Item) and 数值 (Value).

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, including 项目 (Item) and 基金份额 (Fund Shares).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table showing the details of transactions for the fund manager's proprietary investment in the fund, including 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), etc.

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table showing the shareholding situation of the fund at the end of the reporting period, including 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), etc.

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 showing the situation of investors holding a shareholding ratio of 20% or more during the reporting period, including 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), etc.

影响投资者决策的其他重要信息

无。

备查文件目录

- 1. 《华安安逸半年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
2. 《华安安逸半年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
3. 《华安安逸半年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》

存放地点

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

查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网网站查阅，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。