国寿安保日标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年第1季度报告

2019-04-19

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

报告送出日期：2019-04-22

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标和基金净值表现
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 财务报告（未经审计）
§7 投资组合报告
§8 基金份额持有人户数及持有人结构情况
§9 开放式基金持有人大额申购（含转换入）、赎回（含转出）情况统计
§10 重大事件揭示
§11 影响投资者决策的其他重要信息
§12 备查文件目录

§1 重要提示

基金管理人及其董事会或董事会授权的投资决策委员会成员，应保证报告内容的真实性、准确性和完整性，并对报告内容的个别及连带责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年04月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，但不保证本基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期内2019年01月01日至2019年03月31日。

§2 基金简介

项目	内容
基金名称	国寿安保日标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	国寿安保日标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金主代码	009018
交易代码	009018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017-10-24
报告期末基金份额总额	11,477,880.72份
投资目标	本基金通过灵活适应市场变化策略，在经济周期转换、产业生命周期变化、产业内部分化等主题下，积极挖掘具有核心竞争优势的公司，在为客户创造长期稳定收益的前提下，实现资产的长期稳健增值。本基金将通过分析宏观经济、证券市场基本面、产业趋势、公司治理等因素，确定不同阶段基金资产配置、债券、股票投资工具及其组合的久期、杠杆、风险预算等。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过分析宏观经济、证券市场基本面、产业趋势、公司治理等因素，确定不同阶段基金资产配置、债券、股票投资工具及其组合的久期、杠杆、风险预算等。 2、股票投资策略 本基金将采用价值、成长、主题投资策略，在行业层面进行大类资产配置，在个股层面进行精选个股。 3、债券投资策略 本基金将采用久期、杠杆、风险预算等策略，在不同阶段调整债券投资组合的久期、杠杆、风险预算等。 4、资产支持证券投资策略 本基金将采用信用分析、收益率曲线分析、现金流分析、提前还款分析、利率期限结构分析、期权调整利差分析等方法，在控制风险的前提下，根据市场情况，选择合适的资产支持证券品种进行投资。
业绩比较基准	本基金为灵活平衡型，预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金，属于较低风险、较低收益品种。
风险收益特征	本基金为灵活平衡型，预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金，属于较低风险、较低收益品种。
基金托管人	广发银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	国寿安保日标策略灵活配置混合型发起式A	国寿安保日标策略灵活配置混合型发起式C
下属分级基金的交易代码	009018	009019
报告期末下属分级基金的份额总额	10,976,939.42份	1,501,036.21份

下属分级基金的业绩比较基准

§3 主要财务指标

主要财务指标	国寿安保日标策略灵活配置混合型发起式A 2019-01-01 - 2019-03-31	国寿安保日标策略灵活配置混合型发起式C 2019-01-01 - 2019-03-31
本期已实现收益	126,800.30	-33,380.48
期末可供出售金融资产变动额	1,437,316.72	254,795.94
期末可供出售金融资产变动额（扣税后）	0.24元	0.19元
期末基金资产净值	9,238,461.42	1,386,402.80
期末基金份额净值	0.842	0.9240

注：1)、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除费用后的余额。本期期末可供出售金融资产变动额、本期期末可供出售金融资产变动额（扣税后）、期末基金资产净值、期末基金份额净值指报告期末（或报告期内最后一个交易日）数据。

2)、上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，计入费用后实际收益水平低于所列数字。

§4 管理人报告

基金管理人及其管理基金的经验

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨阳	固定收益总监、固定收益基金投资经理	2017-10-24	-	14年	2000年12月至2011年5月，历任中国银行股份有限公司理财师、客户经理、投资经理助理、基金经理等职。2011年05月加入国寿安保基金管理有限公司，现任固定收益总监兼任固定收益投资部总监，国寿安保增强分级债券型证券投资基金、国寿安保稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保安福债券型证券投资基金、国寿安保短融债券型证券投资基金、国寿安保稳健增利债券型证券投资基金、国寿安保稳健增利分级债券型证券投资基金、国寿安保稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保日标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保稳健增利灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保稳健增利