

长江乐鑫纯债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：长江证券（上海）资产管理有限公司
基金托管人：浙商银行股份有限公司
报告送出日期：2019-04-22

重要提示

基金管理人的董事会及董事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代表其未来表现。投资有风险。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

基金基本情况表格，包含基金名称、场内简称、基金代码、基金管理人、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、基金托管人等信息。

主要财务指标

主要财务指标表格，包含本期已实现收益、本期利润、加权平均基金份额本期利润、期末基金资产净值、期末基金份额净值等数据。

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(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额... (2) 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用...

基金净值表现

基金净值表现表格，包含阶段、净值增长率、净值增长率标准差、业绩比较基准收益率、业绩比较基准收益率标准差等数据。

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



注：(1) 本基金合同生效日为2018年8月16日，截至本报告期末未满一年。(2) 本基金建仓期为基金合同生效日起6个月内...

其他指标

其他指标表格，包含基金资产净值、基金份额净值、基金份额持有人户数等数据。

基金经理(或基金经理小组)简介

基金经理简介表格，包含姓名、职务、任职日期、离任日期、证券从业年限、说明等信息。

注：(1) 此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日。若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。(2) 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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理人公平交易管理制度》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书的规定...

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理人公平交易管理制度》的相关规定，通过严格的内部控制制度和流程，对各环节的投资风险和风险进行有效控制...

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度，债市进入了平稳期，利率债窄幅震荡，10年期国债收益率3.46%下行一季度末至3.38%。信用债方面，收益率小幅下行，信用利差小幅缩小，其中收益债信用债的信用利差下行速度较去年底季度加快...

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0116元，报告期内，本基金份额净值增长率为1.60%，同期业绩比较基准收益率为1.16%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效日为2018年8月16日，截至本报告期末生效未满三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况表格，包含序号、项目、金额、占基金总资产的比例等数据。

报告期末按行业分类的境内股票投资组合表格，包含序号、行业类别、公允价值、占基金资产净值比例等数据。

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合表格，包含行业类别、公允价值、占基金资产净值比例等数据。

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表格。

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表格。

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表格。

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表格。

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表格。

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国债期货投资明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细表格。

本报告期末基金投资的国债期货持仓和损益明细表格。