

诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金2019年2季度报告

2019-06-30
基金管理人：诺安基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-16

重要提示

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。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2019年7月15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。
本报告中所列数据未经审计。
本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 数值 (Value). Includes 基金简称 (诺安稳固收益一年定期开放债券), 基金代码 (900235), 基金运作方式 (契约型基金), 基金合同生效日 (2013-06-21), 报告期末基金份额总额 (1,676,178,096.11), 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 (诺安基金管理有限公司), 基金托管人 (中国工商银行股份有限公司).

主要财务指标

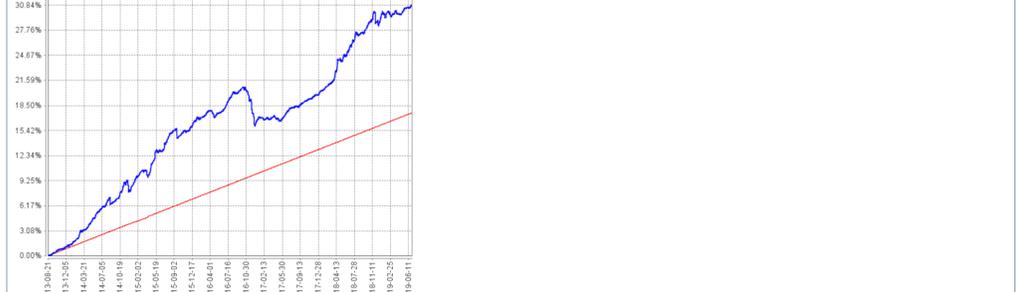
Table with columns: 主要财务指标, 报告期 (2019-04-01 至 2019-06-30), 单位: 人民币元. Includes 本期已实现收益 (12,498,498.53), 本期利润 (8,375,436.54), 加权平均基金份额本期利润 (0.0050), 期末基金资产净值 (1,699,216,066.20), 期末基金份额净值 (1.014).

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，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 (0.58%, 0.08%, 0.61%, 0.01%, -0.11%, 0.05%).

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：注：本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

其他指标

Table with columns: 其他指标, 报告期 (2019-04-01至2019-06-30), 单位: 人民币元. Includes 其他指标 (2019-06-30).

基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理任期 (任职日期, 离任日期), 证券从业年限, 说明. Includes 张鸣翔 (本基金经理, 任职日期: 2016-03-29, 证券从业年限: 8).

注：①此处长基金经理的任职日期为公司作出决定对外公告之日；
②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》的相关规定等。

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，诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金合同》的规定，遵守了本公司内部控制制度，本基金投资管理未发生违法违规行为。

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2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》，制度的范围包括境内上市股票、债券、一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。
报告期内，公司设立公平交易所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和股票市值的不同，建立不同投资组合的证券备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序，公司建立了统一的研究管理平台，所有对外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保证该平台对所有研究员和投资组合经理开放。
报告期内，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易模块，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合同一时间下达了相同方向的交易指令，并且涉及在单一连续体内，投资交易系统会自动将证券交易单自动按比例拆分为各投资组合；对于跨单一市场申购、非公开发行认购申购等非集中竞价交易分配比例，在参与申购之前，各投资组合经理独立确定申购价格和数量，并申购指令下达交易中心，公司在匹配额度范围内，按照价格优先原则进行分配，如果申购价格相同，则按照申购比例分配；对于银行间市场交易，通过固定平台、交易所大宗交易、投资组合经理以该投资组合的名义向交易对手下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易所对手询价、成交确认，并依据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。
报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

异常交易行为的专项说明
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年2季度，公布的经济数据先强后弱，叠加月份中美摩擦再起，权益类资产价格冲高后回落，债券类资产收益率先上后下。具体而言，10年期国债上行约5BP，10年期国债下行约2BP，两者利差差进一步收窄，配置型机构的热情有所回落；信用债方面，虽然违约不断，叠加信用债事件，但信用利差和期限利差基本维持。综合2季度短久期信用债的表现相对较好。
2季度组合规模稳定，管理人维持了利率债增持了信用债，替换了持仓中剩余期限较短和收益率率较低的信用债，组合持仓结构以中高等级信用债为主，组合维持了一定杠杆操作。

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1.014元，本报告期基金份额净值增长率为0.50%，同期业绩比较基准收益率为0.61%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万的情形。

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 (97.64%), 固定收益投资 (97.64%), 资产支持证券, 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其他金融资产, 合计 (2,506,985,623.17).

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 industries like 农林牧渔, 医药生物, 食品饮料, etc.

报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with columns: 行业类别, 公允价值 (元), 占基金资产净值比例 (%). Lists various industries like 基础材料, 消费者非必需品, 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 (%). Includes 000001, 001880, etc.

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 (%). Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券, 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 (%). Includes 190210, 191001, 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资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

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 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. Includes 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).

本基金股指期货投资的投资政策

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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. Includes 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投资国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

本基金本报告期投资的前十名股票的投资主体，本报告期没有出现在监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

本基金本报告期末未持有股票。

其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额 (元), 单位: 人民币元. Includes 存出保证金 (33,778.74), 应收证券清算款, 应收利息 (32,794,697.31), 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股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 数量, 单位: 份. Includes 报告期初基金份额总额 (1,676,178,096.11), 报告期间基金份额申购份额, 报告期间基金份额赎回份额, 报告期间基金拆分变动份额, 报告期末基金份额总额 (1,676,178,096.11).

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, 单位: 份. Includes 报告期初管理人持有的本基金份额, 报告期间买入/申购总份额, 报告期间卖出/赎回总份额, 报告期末管理人持有的本基金份额, 报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)

基金管理人运用固有资金投资本基金明细

Table with columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易份额 (份), 交易金额 (元), 适用费率. Includes 合计.

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 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. Includes 基金管理人自有资金, 基金管理人高级管理人员, 基金管理人基金, 其他, 合计.

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, 持有份额, 份额占比. Includes 机构, 个人.

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，敬请投资者留意。

影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

备查文件目录

- ①中国证监会基金备案材料接收函诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金募集的文件。
②《诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金合同》。
③《诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》。
④基金管理人业务资格批复、营业执照。
⑤诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金2019年第二季度报告正文。
⑥诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金在指定网站上披露的各项公告。

存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。
投资者对本报告如有疑义，可致电本基金管理人全国统一客户服务热线：400-888-9998，亦可至基金管理人网站 www.fund.com.cn查阅详情。