国寿安保聚宝盆货币市场基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:徽商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18日

§1 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。

基金托管人徽商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保聚宝盆货币
交易代码	001096
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月2日
报告期末基金份额总额	1,121,896,176.30份
投资目标	在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越金融比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	7天通知存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	徽商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	8,823,500.13
2.本期利润	8,823,500.13
3.期末基金资产净值	1,121,896,176.30

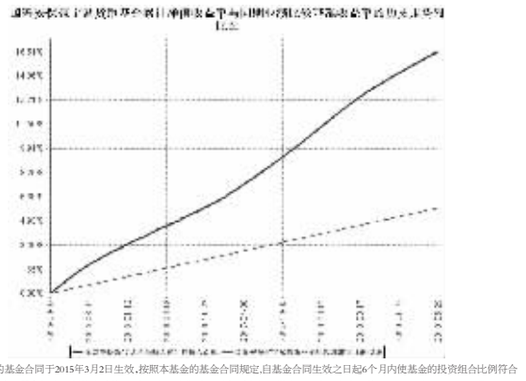
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.6970%	0.0014%	0.3366%	0.0000%	0.3604%	0.0014%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金的基金合同于2015年3月2日生效,按照本基金的基金合同规定,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关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为2015年3月2日至2019年6月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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		
桑迎	基金经理	2015年3月2日	-	17年	硕士研究生,2002年7月至2003年8月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年11月至2008年1月,任职于华夏银行总行资金部,担任交易员;2008年2月至2013年12月,任职于富安基金,历任交易员、基金经理;2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司,现任国寿安保场内实时申赎货币市场基金、国寿安保薪金宝货币市场基金、国寿安保聚宝盆货币市场基金、国寿安保鑫钱包货币市场基金、国寿安保添利货币市场基金及国寿安保货币市场基金基金经理。
张美	基金经理	2017年1月5日	-	7年	曾任中国人寿资产管理有限公司国际部研究员;2013年加入国寿安保基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理,现任国寿安保聚宝盆货币市场基金及国寿安保增金宝货币市场基金基金经理。

注:任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期,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。

4.2 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《证券投资基金法》、《国寿安保聚宝盆货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为;且不存在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超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度中国经济增速略有放缓,宏观杠杆率高速增长势头得到初步遏制,经济增长总体仍保持了韧性。发达国家经济增速持续放缓和中美贸易摩擦升级加大使得出口部门承受了较大压力。在外部环境恶化的国际背景下,房地产投资和基建投资支撑着固定资产投资增速,政府还出台了专项债配套融资政策和汽车家电等行业政策以提振内需。房地产调控政策仍未放松,部分房价上涨的热点城市调控加码,地产信托融资的监管也有所加强。

从政策面来看,稳健的货币政策仍然松紧适度,货币政策在保持定力的同时加强了相机抉择的灵活性。包商事件打破了银行间业信仰,部分中小银行的同业负债被动收缩,部分非银机构也遭遇了流动性紧缩,央行适时适度给予了必要的流动性支持,缓释了流动性分层的负面影响。

二季度A股市场整体震荡调整,上证综指下跌约3.6%,深圳成指下跌约7.3%,创业板综下跌约9.4%。二季度表现较好的行业分别为食品饮料、非银金融、家用电器等。二季度国内债券市场先跌后涨,4月受经济金融数据好于预期,一级市场需求走弱等影响,债券市场大幅下跌,但此后经济预期减弱,美国加征关税和资金面好转等因素共同推动了债券市场利率逐渐下行。

二季度本基金维持了适中的权益配置比例,权益整体配置思路为盈利相对稳定且估值合理的优质公司。基金组合的行业配置相对均衡,其中,配置比例相对较高的行业:银行、电子、家电、汽车、食品饮料、医药生物、非银金融等。本基金的固定收益组合在二季度以中高等级信用债为主要配置品种,总体保持了组合久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保稳瑞混合A基金份额净值为1.0218元,本报告期基金份额净值增长率为-0.22%;截至本报告期末国寿安保稳瑞混合C基金份额净值为1.0201元,本报告期基金份额净值增长率为-0.24%;同期业绩比较基准收益率为-0.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	558,288,972.55	45.80
	其中:债券	558,288,972.55	45.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	197,011,055.52	16.16
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	400,594,294.76	32.86
4	其他资产	63,206,344.95	5.18
5	合计	1,219,100,667.78	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		6.42
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	96,137,751.93	8.57
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本基金报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	49.73	8.57
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	4.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	17.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	4.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	32.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		108.42	8.57

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,993,279.30	2.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,349,823.16	7.16
	其中:政策性金融债	80,349,823.16	7.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,043,467.20	6.24
6	中期票据	-	-
7	同业存单	377,902,402.89	33.68
8	其他	-	-
9	合计	558,288,972.55	49.76
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111813116	18邮商银行CD116	1,000,000	99,878,436.11	8.90
2	111918204	19平安银行CD204	1,000,000	99,395,332.82	8.86
3	111916159	19上海银行CD159	1,000,000	99,388,812.21	8.86
4	160313	16进出13	500,000	50,054,956.65	4.46
5	011901174	19中电资SCP006	500,000	49,994,563.53	4.46
6	111812228	18北京银行CD228	500,000	49,285,973.03	4.39
7	150306	15进出06	300,000	30,294,866.51	2.70
8	180026	18附息国债26	300,000	29,993,279.30	2.67
9	111807190	18招商银行CD190	300,000	29,953,848.72	2.67
10	011900275	19中船投SCP001	200,000	20,048,903.67	1.79

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0832%
报告期内偏离度的最低值	-0.0053%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0277%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	60,448,500.00
3	应收利息	2,674,664.95
4	应收申购款	83,180.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	63,206,344.95

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,342,457,930.22
报告期期间基金总申购份额	889,666,566.93
报告期期间基金总赎回份额	1,110,228,320.85
报告期期末基金份额总额	1,121,896,176.30

注:报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2019年6月30日	13,473.79	13,473.79	-
合计			13,473.79	13,473.79	

注:基金管理人运用固有资金投资本基金皆通过直销机构进行,申购和赎回交易日期指交易申请日;本基金不收取申购费用和赎回费用;本基金每日分配收益并结转为基金份额,上述红利再投资金额为整个报告期内数据之和。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准国寿安保聚宝盆货币市场基金募集的文件

9.1.2《国寿安保聚宝盆货币市场基金基金合同》

9.1.3《国寿安保聚宝盆货币市场基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保聚宝盆货币市场基金在指定媒体上披露的各项公告

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司,地址:北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11层

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息:www.gsfunds.com.cn

9.3.3 按打本公司客户服务电话垂询:4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司
2019年7月18日

长信纯债壹号债券型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18日

§1 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金基金的合同规定,于2019年7月17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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信纯债壹号债券	
基金主代码	519985	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年7月1日	
报告期末基金份额总额	744,554,784.52份	
投资目标	本基金通过投资于债券品种,追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	1.资产配置策略; 2.类属配置策略; 3.个券选择策略; 4.骑乘策略; 5.息差策略; 6.利差策略; 7.资产支持证券的投资策略; 8.国债期货的投资策略。	
业绩比较基准	中债综合指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于低风险的基金品种。	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信纯债壹号债券A	长信纯债壹号债券C
下属分级基金的交易代码	519985	004220
报告期末下属分级基金的份额总额	339,984,450.57份	404,570,333.95份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	长信纯债壹号债券A	长信纯债壹号债券C
1.本期已实现收益	5,335,730.69	4,335,526.18
2.本期利润	2,452,105.60	1,515,345.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0036
4.期末基金资产净值	411,001,285.12	451,320,715.91
5.期末基金份额净值	1.2089	1.1156

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

2.所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(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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

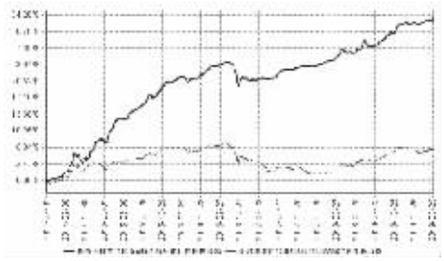
长信纯债壹号债券A

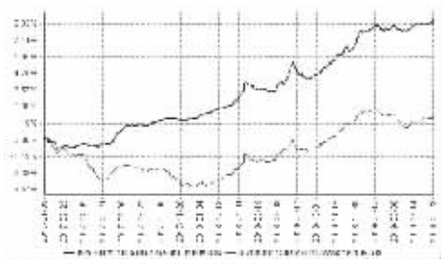
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.51%	0.03%	-0.24%	0.06%	0.75%	-0.03%

长信纯债壹号债券C

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
过去三个月	0.35%	0.03%	-0.24%	0.06%	0.59%	-0.03%

3.2.2 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.基金管理人自2017年1月9日起对长信纯债壹号债券基金进行份额分类,原有基金份额为A类份额,增设C类份额。

2.长信纯债壹号债券A图示日期为2014年7月1日至2019年6月30日,长信纯债壹号债券C图示日期为2017年1月9日(份额增加日)至2019年6月30日。

3.按基金合同规定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时,本基金各项投资比例已符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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		
张文刚	长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金和长信长金通货币市场基金的基金经理,固定收益部总监	2014年7月1日	-	25年	高级工商管理硕士,上海财经大学EMBA毕业,具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理,固定收益总部交易部经理,2004年9月加入长信基金管理有限责任公司,历任长信利息收益开放式证券投资基金交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金、长信中短债证券投资基金基金经理职务,现任固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金通货币市场基金的基金经理。

注:任职日期为基金合同生效日,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。

4.2 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《证券投资基金法》、《国寿安保稳瑞混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度,本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为;且不存在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超过该证券当日成交量的5%的情形。未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金管理人在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司已实行公平交易制度,并建立公平交易制度体系,已建立投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外,其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度债券市场维持震荡格局。4月中旬政治局会议再提"去杠杆",经济基本面和政策出现边际变化,货币政策进入观察期,或有边际收紧的迹象,债券收益率先快速上行后略有下行;但5月初的贸易战恶化和5月底的包商银行接管事件,再次扭转货币政策边际收紧的趋向,宽松边际再次加码。市场表现为短端资金利率创新低,但收益率曲线长端利率部分波动不大。

二季度,我们适当调整了部分券种,降低了利率债和部分信用债仓位,加大了灵活操作的力度。

4.4.2 2019年三季度市场展望和投资策略

展望三季度,在全球经济共振下行的背景下,中国经济增长小幅下行概率较大,但总体上仍然以稳为主。同时,货币政策会随着经济下行而小幅放松,其着力点也在于总量上的稳,用结构性的精准滴灌代替传统的总量型大水漫灌。地产周期回归下总需求边际承压,财政政策支出端再次发力,货币政策和流动性环境宽松周期回归,流动性分层扰动仍在,贸易谈判存在较大不确定性,趋势性利好下存在债市行情,利率交易空间仍在,但受到相对位置限制,需高度关注"预期差"带来的市场交易机会。

我们将继续秉承谨慎原则,加强组合的流动性管理,加大对信用风险的审慎判断,适度调整组合久期,密切关注经济走势和政策动向,紧跟组合规模变动进行资产配置,争取在流动安全的前提下,为投资者获取更好的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年6月30日,本基金A类份额净值为1.2089元,累计份额净值为1.4589元;本基金C类份额净值为1.1156元,累计份额净值为1.4356元。本报告期内本基金A类净值增长率为0.51%,同期业绩比较基准收益率为-0.24%;本基金C类份额净值增长率为0.35%,同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,027,261,070.00	98.40
	其中:债券	1,027,261,070.00	98.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,534,335.06	0.15
8	其他资产	15,167,338.41	1.45
9	合计	1,043,962,743.47	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	141,897,000.00	16.46
	其中:政策性金融债	141,897,000.00	16.46
4	企业债券	302,253,070.00	35.05
5	企业短期融资券	260,253,000.00	30.18
6	中期票据	322,858,000.00	37.44
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,027,261,070.00	119.13

5.5 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

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(%)
1	180208	18国开08	800,000	81,408,000.00	9.44
2	143623	18粤电01	500,000	51,030,000.00	5.92
3	1380032	13海控债	500,000	50,865,000.00	5.90
4	180202	18国开02	500,000	50,560,000.00	5.86
5	011901153	19开滦SCP002	400,000	40,044,000.00	4.64

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未投资股票,不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,061.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,845,842.63
5	应收申购款	283,434.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,167,338.41

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长信纯债壹号债券A	长信纯债壹号债券C
报告期期初基金份额总额	366,600,335.35	428,682,228.44
报告期期间基金总申购份额	190,466,746.23	59,871,568.71
减:报告期期间基金总赎回份额	217,082,631.01	83,983,463.20
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	339,984,450.57	404,570,333.95

注:报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过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
机构	1	20190401-20190630	100,012,500.00	-	-	100,012,500.00	40.00%
	2	20190401-20190630	150,019,250.00	-	-	150,019,250.00	60.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。

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,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准国寿安保稳瑞混合型证券投资基金募集的文件

9.1.2《国寿安保稳瑞混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《国寿安保稳瑞混合型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保稳瑞混合型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司,地址:北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11层

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息:www.gsfunds.com.cn

9.3.3 按打本公司客户服务电话垂询:4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司
2019年7月18日

国寿安保稳瑞混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

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年7月18日

§1 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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保稳瑞混合	
交易代码	004760	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年2月7日	
报告期末基金份额总额	250,045,539.54份	
投资目标	本基金将通过对宏观经济和资本市场的深入分析,采用主动的投资管理策略,把握不同时期各金融市场的收益水平,在约定的投资比例下,合理配置股票、债券、货币市场工具等各类资产,在严格控制下行风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金的资产配置策略注重将定性资产配置和定量资产配置进行有机的结合,根据经济情势、类别资产收益风险报期等因素,确定不同阶段基金资产中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,力争获得基金资产的长期稳定增值。	
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金,按照风险收益水平相应会高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中等风险收益的投资品种。	
基金管理人	国寿安保基金管理有限