人保鑫盛纯债债券型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人:中国人保资产管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2019年08月24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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	人保鑫盛纯债	
基金主代码	006638	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年12月25日	
基金管理人	中国人保资产管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	161,862,270.40份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	人保鑫盛纯债A	人保鑫盛纯债C
下属分级基金的交易代码	006638	006639
报告期末下属分级基金的份额总额	158,240,668.87份	3,621,601.53份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险并保持资产流动性的基础上,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用期限匹配下的主动性投资策略,主要包括:类属资产配置策略、期限结构策略、久期调整策略、个券选择策略、分散投资策略、回购套利策略、可转换公司债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等投资管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行预测,相机而动、积极调整。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中国人保资产管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕传红	王永民
	联系电话	010-69009696	010-66594896
	电子邮箱	lvch@piccamc.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-820-7999	95566
传真		021-50765598	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日－2019年06月30日)	
	人保鑫盛纯债A	人保鑫盛纯债C
本期已实现收益	5,277,784.93	240,782.19
本期利润	5,320,534.15	306,952.92
加权平均基金份额本期利润	0.0203	0.0201
本期基金份额净值增长率	2.01%	1.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0203	0.0181
期末基金资产净值	161,458,705.12	3,687,037.50
期末基金份额净值	1.0203	1.0181

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、期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如:基金的申购、赎回费等,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 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

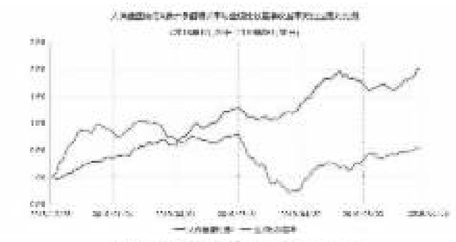
人保鑫盛纯债A

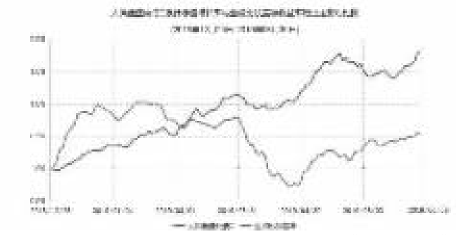
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.21%	0.05%	0.28%	0.03%	-0.07%	0.02%
过去三个月	0.72%	0.05%	-0.24%	0.06%	0.96%	-0.01%
过去六个月	2.01%	0.04%	0.24%	0.06%	1.77%	-0.02%
自基金合同生效起至今	2.03%	0.04%	0.56%	0.06%	1.47%	-0.02%

人保鑫盛纯债C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.18%	0.05%	0.28%	0.03%	-0.10%	0.02%
过去三个月	0.64%	0.05%	-0.24%	0.06%	0.88%	-0.01%
过去六个月	1.79%	0.04%	0.24%	0.06%	1.55%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.81%	0.04%	0.56%	0.06%	1.25%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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、本基金基金合同于2018年12月25日生效。根据基金合同规定,本基金建仓期为6个月,建仓期满,本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

2、本基金业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中国人保资产管理有限公司(简称人保资产)成立于2003年7月16日,是经国务院同意、中国保监会批准,由中国人民保险集团股份有限公司(股票代码:601319.SH,1339.HK)发起设立的境内第一家保险资产管理公司。目前管理资产逾万亿元人民币,具备保监会核准的股票投资能力、无担保债券投资能力、股权投资能力、基础设施投资计划产品创新能力、不动产投资计划产品创新能力、衍生品运用能力(股指期货)和信托产品投资能力,具有人社部批准的企业年金投资管理人资格和国家外管局批准的经营外汇业务资格,获选基本养老保险基金证券投资管理机构,获准发行投资理财产品和受托管理合格投资者资金,获批开展公募基金业务,是中国资本市场秉持价值投资理念、为客户创造绝对收益的重要机构投资者之一。

成立十余年来,人保资产以保险资金运用为主业,基于资产负债匹配管理理念,探索建立了从资产战略配置、资产战术配置、资产交易配置到集中交易和全流程风险管控的资产管理价值链,并着眼于构建能够获得持续稳定收益的资产组合,坚持以绝对收益为核心的收益缺口管理原则,为委托人贡献了长期稳定的投资收益。

十余年来,中国金融市场日趋成熟,财富管理行业日渐交融。人保资产科学筹划发展战略,积极把握第三方业务的发展机遇和另类资产的投资机会,在国内保险资产管理机构中较早开展了第三方保险机构的专户管理和企业年金与养老金投资管理业务,并积极创新和开展股权投资、基础设施债权投资业务、资产管理产品等业务,积极筹备公募基金业务,形成了专户管理、资产管理产品、债权投资计划、股权投资计划、不动产投资计划、企业年金、养老金产品和外汇投资等业务多元化发展的格局,与国内各主要金融机构和大中型龙头企业建立了良好的合作关系。

自成立以来,人保资产始终坚持专业化发展、市场化经营、规范化运作,是第一家建立"委托-受托-托管"资金三方存管机制的保险资产管理机构,并探索建立了覆盖投资全流程的风险防控体系;十余年来,人保资产还培养了具备国际投资视野、历经市场多周期磨练的投研管理和业务执行团队,忠实履行了对各委托人的价值创造承诺。

面向潜力无限、变革加快、竞争激烈的财富管理市场,人保资产依托强大的资源优势和卓越的专业团队,秉承"忠人之事,超越基准"的企业精神,坚持"诚信铸就品牌,专业创造价值"的经营理念,不断开创市场化引领下创新驱动的专业化发展新局面,努力将公司打造成为具有市场竞争优势的国际一流、国内领先的综合性投资理财公司。

人保资产于2017年1月11日获得中国证监会《关于核准中国人保资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》(证监许可[2017]107号),于2017年3月29日获得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。截至2019年6月30日,人保资产旗下共管理18只基金产品,分别为人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保量化基本面混合型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保安惠三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保优势产业混合型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保福睿18个月定期开放债券型证券投资基金和人保行业轮动混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁婷	基金经理	2018-12-25	-	19年	中国社会科学院经济学博士。曾任长盛基金管理有限公司社保基金投资经理、社保业务管理部副总监、安邦资产管理有限公司固定收益事业部总经理、组合管理部总经理。2017年11月加入人保资产公募基金事业部,任投资总监。2018年8月9日起任人保鑫利回报债券型证券投资基金基金经理。2018年11月13日起任人保鑫裕增强债券型证券投资基金基金经理。2018年12月25日起任人保鑫盛纯债债券型证券投资基金基金经理。2019年4月16日起任人保福睿18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日。

2、非首任基金经理,其"任职日期"为公告确定的聘任日期。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下所有公募基金投资组合,建立了公平交易制度和流程。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》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有公募基金投资组合,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金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5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,宏观经济、金融数据均经历了较大起落,呈现一季度快速反弹并在二季度大幅回落的态势,总体来看社融数据基本触底,但经济在结构上仍呈现基建地产相对较强而工业生产、制造业和消费偏弱的格局,经济复苏动能较弱,信用传导依然任重道远。债券市场总体环境偏暖,

债券市场上半年经历了宽幅波动,一季度在宽信用政策影响下,债券市场年初起呈现利率债调整而信用债偏暖的格局,之后在良好的社融数据影响下,利率债及高等级信用债均出现调整。随着4、5月份经济数据回落得到确认,同时美国降息预期提升,欧美债市收益率大幅下行,债券市场又开始一波明显的收益率下行。直至包商事件爆发,导致金融市场流动性分层和信用溢价提升,从而引发利率债重新受到追捧而中低等级信用债及民企债收益率大幅上行。

报告期内,基金以信用债投资为主,阶段性参与了利率债投资机会,同时适当参与了可转债的波段机会,为基金获得了一定的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为1.0203元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为2.01%,同期业绩比较基准收益率为0.24%;截至报告期末基金份额净值为1.0181元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为1.79%,同期业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为下半年国内经济将处于触底并平稳运行阶段,高质量增长依然是政策追求目标,国内基本面、海外资金配置对于利率债市场仍然友好。此外,在降低实体经济融资成本的方向之下,信用传导将是货币政策发力方向,我们对信用债市场总体持相对乐观态度。我们也将密切关注通胀走势和信用风险,积极把握利率债和信用债市场的机会,把握好类属资产配置与调整的节奏,力争为基金获取较好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会,成员主要由公募基金事业部投资部门、研究部门、合规风控部门及公司运营管理部门人员组成,以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理列席会议,但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在人保鑫盛纯债债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:人保鑫盛纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	10,808,353.30	1,905,984.12
结算备付金	3,245,162.05	-
存出保证金	45,960.80	-
交易性金融资产	187,364,244.00	39,161,967.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	179,364,244.00	39,161,967.00
资产支持证券投资	8,000,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	354,700,000.00
应收证券清算款	28,559,210.59	-
应收利息	4,071,511.01	909,937.37
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	234,094,441.75	396,677,888.49
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	39,500,000.00	10,000,000.00
应付证券清算款	-	1,312,823.96
应付赎回款	29,195,849.60	-
应付管理人报酬	105,495.12	37,993.46
应付托管费	35,165.05	12,664.49
应付销售服务费	1,043.69	3,111.80
应付交易费用	2,012.27	-
应交税费	24,347.73	540.19
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	84,785.67	1,881.74
负债合计	68,948,699.13	11,369,015.64
所有者权益:		
实收基金	161,862,270.40	385,227,012.58
未分配利润	3,283,472.22	81,860.27
所有者权益合计	165,145,742.62	385,308,872.85
负债和所有者权益总计	234,094,441.75	396,677,888.49

注:报告截止日2019年6月30日,人保鑫盛纯债A基金份额净值为1.0203元,基金份额总额158,240,668.87份;人保鑫盛纯债C基金份额净值为1.0181元,基金份额总额3,621,601.53份;总份额合计161,862,270.40份。

6.2 利润表

会计主体:人保鑫盛纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期2019年01月01日 至2019年06月30日
一、收入	7,161,252.05
1.利息收入	6,047,515.86
其中:存款利息收入	42,873.52
债券利息收入	4,878,849.08
资产支持证券利息收入	11,610.10
买入返售金融资产收入	1,114,183.16
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	861,944.48
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	861,944.48
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	108,919.95
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	142,871.76
减:二、费用	1,533,764.98
1.管理人报酬	833,897.32
2.托管费	277,965.78
3.销售服务费	22,424.76
4.交易费用	6,791.01
5.利息支出	290,531.25
其中:卖出回购金融资产支出	290,531.25
6.税金及附加	14,589.26
7.其他费用	87,565.60
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	5,627,487.07
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	5,627,487.07

注:本基金基金合同于2018年12月25日生效,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:人保鑫盛纯债债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	385,227,012.58	81,860.27	385,308,872.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,627,487.07	5,627,487.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-223,364,742.18	-2,425,875.12	-225,790,617.30
其中:1.基金申购款	1,357,714.14	15,858.24	1,373,572.38
2.基金赎回款	-224,722,456.32	-2,441,733.36	-227,164,189.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	161,862,270.40	3,283,472.22	165,145,742.62

注:本基金基金合同于2018年12月25日生效,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王颢	周海	沈静
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

人保鑫盛纯债债券型证券投资基金(以下简称"本基金")系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保鑫盛纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同") 及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")以证监许可[2018]1763号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为385,227,012.58份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第00514号验资报告。基金合同于2018年12月25日正式生效。本基金的基金管理人为中国人保资产管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金份额分为A类基金份额(以下简称"人保鑫盛纯债A")和C类基金份额(以下简称"人保鑫盛纯债C")两类份额。其中,人保鑫盛纯债A是指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;人保鑫盛纯债C是指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,但在赎回时收取赎回费,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、央行票据、中期票据、同业存单、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款、定期存款)、国债期货等以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资股票、权证,也不参与新股申购或增发新股。因可转债与可交换债券转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易可转债而产生的权证,本基金将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资债券的比例不低于基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2019年1月1日至2019年6月30止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的,将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

1)对于银行间市场交易的固定收益品种,以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2)对存在活跃市场的其他投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值;对于发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3)对存在活跃市场的其他投资品种,如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

4)当投资品种不再存在活跃市场,基金管理人估值委员会认为必要时,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且目前可执行该种法定权利,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后,逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内,按摊余成本和实际收益率计算确认利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券摊余成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认,由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提。

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值0.30%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3)基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4)由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号),在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告 [2017]13号) 及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3)根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国人保资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注:下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立,与本基金管理人同受一方控制的关联方发生的交易根据实际发生情况于下文分别列示。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易,无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行权证交易,无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行债券交易,无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行回购交易,无上年度可比期间数据。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无需要支付关联方的佣金,无上年度可比期间数据。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	833,897.32
其中:支付销售机构的客户维护费	444,567.37

注:支付的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	277,965.78

注:支付的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保鑫盛纯债A	人保鑫盛纯债C	合计
中国人保资产管理有限公司	0.00	7,644.89	7,644.89
中国银行股份有限公司	0.00	12,182.88	12,182.88
合计	0.00	19,827.77	19,827.77

注:本基金实行销售服务费分级收费方式,分设A、C两类基金份额:A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值×0.30%的年费率来计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:C类基金份额每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易,无上年度可比期间数据。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	10,808,353.30	17,414.50

注:本基金由基金托管人中国银行股份有限公司保管的银行存款利息收入,按银行同业或协议利率计算。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况,无上年度可比期间数据。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须说明的其他关联交易事项,无上年度可比期间数据。

6.4.9 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
99DB58	信融08优	2019-06-19	2019-08-12	认购证券未上市	100.00	100.00	80,000	8,000,000.00	8,000,000.00	

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末银行间市场无正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额39,500,000.00元,于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中无属于第一层次的余额,第二层次的余额为人民币179,364,244.00元,第三层次的余额为人民币8,000,000.00元。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

截至本报告期末,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第三层次的余额为人民币8,000,000.00元,其中交易所挂牌转让的资产支持证券为人民币8,000,000.00元,其估值与初始投资成本一致。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	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	187,364,244.00	80.04
	其中:债券	179,364,244.00	76.62
	资产支持证券	8,000,000.00	3.42
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	14,053,515.35	6.00
8	其他各项资产	32,676,682.40	13.96
9	合计	234,094,441.75	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	12,307,380.00	7.45
	其中:政策性金融债	12,307,380.00	7.45
4	企业债券	111,876,364.00	67.74
5	企业短期融资券	36,028,200.00	21.82
6	中期票据	19,152,300.00	11.60
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	179,364,244.00	108.61

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	108603	国开1804	123,000	12,307,380.00	7.45
2	101553035	15冀中MTN002	100,000	10,155,000.00	6.15
3	112542	17TCL02	100,000	10,141,000.00	6.14
4	136244	16华夏02	98,560	10,122,112.00	6.13
5	143735	18方正09	100,000	10,112,000.00	6.12

7.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	99DB58	信融08优	80,000	8,000,000.00	4.84

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	45,960.80
2	应收证券清算款	28,559,210.59
3	应收股利	-
4	应收利息	4,071,511.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,676,682.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
人保鑫盛纯债A	328	482,441.06	0.00	0.00%	158,240,668.87	100.00%
人保鑫盛纯债C	47	77,055.35	0.00	0.00%	3,621,601.53	100.00%
合计	368	439,843.13	0.00	0.00%	161,862,270.40	100.00%

注:机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	人保鑫盛纯债A	24,858.33	0.02%
	人保鑫盛纯债C	119.93	0.00%
	合计	24,978.26	0.02%

注:对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	人保鑫盛纯债A	0~10
	人保鑫盛纯债C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	人保鑫盛纯债A	0~10
	人保鑫盛纯债C	-
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	人保鑫盛纯债A	人保鑫盛纯债C
基金合同生效日(2018年12月25日)基金份额总额	322,122,871.93	63,104,140.65
本报告期期初基金份额总额	322,122,871.93	63,104,140.65
本报告期基金总申购份额	485,143.28	872,570.86
减:本报告期基金总赎回份额	164,367,346.34	60,355,109.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	158,240,668.87	3,621,601.53

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;

2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

2019年5月,陈四清先生因工作调动,辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。目前事务所已提供审计服务从基金成立起至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下:

(1) 基本情况:包括但不限于资本充足,财务状况及最近三年盈利情况良好;主要股东实力强大;具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合进行证券交易的需要,并能为投资组合提供全面的信息服务;

(2) 公司治理:公司治理完善,股东会、董事会、监事会及管理层权责明确,内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足投资组合运作高度保密的要求;

(3) 研究实力:有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员;研究覆盖面广,能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域,并能在符合相关法规及执业规范的前提下,根据公司的特定要求,提供专题研究报告;研究报告应分析严谨,观点独立、客观,并具备较强风险意识和风险测算能力;

2、基金交易单元的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	714,558,301.02	100.00%	3,692,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

本基金本报告期内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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

中国人保资产管理有限公司
二〇一九年八月二十四日