

富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金2019年第二季度报告

2019-06-30
基金管理人：富安达基金管理有限公司
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期：2019-07-18

重要提示

基金管理人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。基金管理人上海浦东发展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，保证基金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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes 基金名称 (富安达长盈混合), 场内简称 (富安达), 基金主代码 (002584), 基金运作方式 (契约型开放式), 基金合同生效日期 (2016-05-11), 报告期末基金份额总额 (8,786,213.30), 投资策略 (有效控制组合风险并保持良好的流动性...), 业绩比较基准 (沪深300指数收益率*40%+中国债券总指数收益率*60%), 风险收益特征 (本基金为混合型基金...), 基金管理人 (富安达基金管理有限公司), 基金托管人 (上海浦东发展银行股份有限公司)

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan). Includes 本期已实现收益 (468,305.2), 本期利润 (-315,019.03), 加权平均基金份额本期利润 (-0.058), 期末基金份额净值 (8,911,345.16), 期末基金份额净值 (1.014)

基金净值表现

Table with 2 columns: 阶段 (Period) and 净值增长率① (Net Value Growth Rate ①). Includes 过去三个月 (-3.52%), 过去六个月 (-1.28%), 过去一年 (-0.39%), 过去三年 (0.90%), 过去五年 (-3.13%), 过去十年 (0.38%)

注: ①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, 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。

富安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: 根据《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定, 本基金建仓期6个月, 建仓截止日为2018年11月18日, 建仓期结束对基金各项资产配置符合本基金合同规定的比例限制和投资组合的比例范围。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 单位: 人民币元 (Unit: RMB Yuan). Includes 其他指标 (Other Indicators) for the reporting period (2019-04-01 to 2019-06-30).

基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Term of Service as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Includes 朱义 (Zhu Yi) as the fund manager since 2018-04-13.

注: 1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日; 担任新成立基金的基金经理, 即基金的首任基金经理, 其任职日期为基金合同生效日, 其离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日; 2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理规定的有关规定。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其各项实施准则、《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金合同》和其他有关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 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, 无损害基金份额持有人利益的行为, 本基金无违法违规、违规行为, 本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》, 并建立了健全有效的公平交易执行和监控系统, 涵盖了所有投资组合, 并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监控稽核各环节, 确保公平对待旗下每一个投资组合。本报告期内, 公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

异常交易行为的专项说明
本报告期内, 本基金不存在异常交易行为。

报告期内基金的投资策略和运作分析

今年二季度以来市场进入调整阶段, 一方面四月市场核心货币政策边际有所调整, 二是五月美国对华为禁令出台, 中美贸易摩擦有进一步升级的趋势, 市场估值回归完成之后, 市场风险偏好快速下滑, 本基金保持了较高持仓, 主要配置在食品饮料、医药、家电等消费类行业以及金融、地产等低估值行业, 参与了电子、通讯等行业投资机会, 但受到中美贸易摩擦的影响, 使得有所拖累, 随着Q2中美贸易摩擦暂缓, 科技类个股有望获取较好的投资回报。

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达长盈混合基金份额净值为1.014元, 本报告期内, 基金份额净值增长率为-3.52%, 同期业绩比较基准收益率为-0.39%。

报告期内基金份额持有人或基金资产净值预警说明

本报告期内, 本基金未出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形, 针对该情形, 本基金管理人的解决方案为: 稳健运作, 做好基金业绩, 稳定基金规模; 积极沟通, 整合资源, 有序推进营销工作。上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实执行措施。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的情形。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in RMB Yuan), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets). Includes 权益类投资 (Equity Investment) 71.93%, 固定收益投资 (Fixed Income Investment) 21.93%, 买入返售金融资产 (Repurchase Agreements) 27.32%, 其他资产 (Other Assets) 0.76%, 合计 (Total) 100.00%

注: 由于四舍五入的原因, 各比例的分项之和与合计可能有尾差。

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets Value). Includes 农林牧渔 (Agriculture, Forestry, Animal Husbandry and Fishing) 1.27%, 采矿业 (Mining) 37.71%, 制造业 (Manufacturing) 4.92%, 电力、热力、燃气及水生产和供应业 (Electricity, Heat, Gas and Water Supply) 2.48%, 建筑业 (Construction) 0.96%, 批发和零售业 (Wholesale and Retail Trade) 6.52%, 交通运输、仓储和邮政业 (Transportation, Storage and Postal and Telecommunications) 4.86%, 住宿和餐饮业 (Accommodation and Food Services) 1.29%, 信息技术、软件和信息技术服务业 (Information Technology, Software and Information Technology Services) 2.43%, 金融业 (Finance) 11.02%, 房地产业 (Real Estate) 6.52%, 租赁和商务服务业 (Leasing and Business Services) 4.86%, 科学研究和技术服务业 (Science, Research and Technology Services) 1.29%, 水利、环境和公共设施管理业 (Water Conservancy, Environment and Public Facility Management) 2.43%, 居民服务、修理和其他服务业 (Residential Services, Repair and Other Services) 1.29%, 教育 (Education) 2.15%, 卫生和社会工作 (Health and Social Work) 2.12%, 文化、体育和娱乐业 (Culture, Sports and Entertainment) 2.15%, 合计 (Total) 73.73%

注: 由于四舍五入的原因, 各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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 5 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets Value). Includes 格力电器 (Gree Electric Appliances) 3.17%, 海康威视 (Hikvision) 2.30%, 保利地产 (Poly Real Estate) 2.29%, 携程集团 (Ctrip) 2.14%, 光大银行 (Everbright Bank) 2.11%, 中兴通讯 (ZTE) 2.10%, 中国银行 (Bank of China) 1.69%, 卫宁健康 (Weineng Health) 1.67%, 伊利股份 (Yili Food) 1.63%, 万科A (Vanke A) 1.61%

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets Value). Includes 国家债券 (Government Bonds) 1.00%, 央行票据 (Central Bank Bills) 1.00%, 金融债券 (Financial Bonds) 1.00%, 企业债券 (Corporate Bonds) 1.00%, 企业短期融资券 (Corporate Short-term Financing Notes) 1.00%, 中期票据 (Medium-term Notes) 1.00%, 可转债(可交换债) (Convertible Bonds/Exchangeable Bonds) 1.00%, 同业存单 (Interbank Deposits) 1.00%, 其他 (Others) 1.00%, 合计 (Total) 1.00%

注: 本基金本报告未持有债券。

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债券投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity in Tens of Thousands of RMB Yuan), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets Value). Includes 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%

注: 本基金本报告未持有债券。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 资产支持证券名称 (Asset-backed Security Name), 数量(份) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets Value). Includes 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%

注: 本基金本报告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

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量(份) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets Value). Includes 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%

注: 本基金本报告未持有贵金属。

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

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in RMB Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Assets Value). Includes 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%

注: 本基金本报告未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约价值(元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险说明 (Risk Statement). Includes 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%

注: 本基金本报告未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约价值(元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险说明 (Risk Statement). Includes 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%

注: 本基金本报告未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size (Buy/Sell)), 合约价值(元) (Contract Value in RMB Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in RMB Yuan), 风险说明 (Risk Statement). Includes 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%, 1.00%

注: 本基金本报告未持有国债期货。

投资组合报告附注

受调查及处罚情况
报告期内, 本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求, 未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现被监管部门立案调查, 在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。2019年11月8日, 中国证监会稽查总队出具行政处罚决定书(2019)10号行政处罚决定书, 没收光大银行违法所得100万元, 罚款1200万元, 主要违法违规事实如下: 内控管理严重违反审慎经营规则; 以误导方式违规销售理财产品; 以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品, 违规以类信贷业务收费或提供不符合的债务, 同业投资违规接受担保; 通过同业投资或贷款渠道违规放贷。

在本基金对证券的投资过程中, 本基金管理人严格遵守法律法规和公司管理制度的前提下, 经公司审慎研究评估, 将该股票纳入投资库并进行投资, 整个过程中严格执行了相关的投资决策程序, 不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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
本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

其他资产构成
单位: 人民币元

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in RMB Yuan). Includes 存出保证金 (14,527.39), 应收证券清算款 (50,581.43), 应收利息 (1,000.34), 应收申购款 (3,063.15), 其他应收款 (1.00), 其他 (1.00), 合计 (69,172.31)

注: 由于四舍五入的原因, 各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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: 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数量 (Quantity). Includes 报告期初基金份额总额 (8,762,499.92), 报告期申购基金份额 (29,108.14), 报告期赎回基金份额 (1,005,394.76), 报告期期末基金份额总额 (7,786,213.30)

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人持有本基金份额变动情况
单位: 份

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Fund Shares). Includes 报告期初管理人持有的本基金份额, 报告期间买入/申购的基金份额, 报告期间卖出/赎回的基金份额, 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本基金总份额比例(%)

注: 本报告期内, 基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况, 不存在利益冲突、显失公平的关联交易的情况。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额(份) (Transaction Shares), 交易金额(元) (Transaction Amount in RMB Yuan), 适用费率 (Applicable Rate)

注: 本报告期内不存在基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

基金资产净值及基金份额持有人数量情况

Table with 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额总数 (Initiated Shares Total), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额承诺持有期限 (Initiated Shares Commitment Holding Period)

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 5 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval when Holding Shares Proportion Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Start Period Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Holding Shares), 份额占比 (Share Proportion)

注: 无

影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2019年4月10日, 富安达基金管理有限公司关于与通联支付合作开通招商银行、农业银行、华夏银行及民生银行借记卡网上支付业务并开展费率优惠活动的公告
2、2019年4月20日, 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加阳光人寿为代销机构并开通转换业务的公告
3、2019年4月20日, 富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金2019年第一季度报告
4、2019年4月21日, 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京泰康人寿保险有限公司为代销机构及参与费率优惠活动的公告
5、2019年4月28日, 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加西藏东方财富证券股份有限公司代销机构及其参与费率优惠活动的公告
6、2019年5月15日, 基金投资者风险提示与基金产品风险
7、2019年5月30日, 富安达基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告
8、2019年6月10日, 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券为代销机构并开通转换业务的公告
9、2019年6月21日, 富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金2019年第二季度报告
10、2019年6月28日, 富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一九年第一号)正文及摘要

备查文件目录

- 1、中国证监会核准富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;
《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
3、基金管理人业务资格牌照和营业执照;
4、基金托管人业务资格牌照和营业执照;
5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;
6、中国证监会要求的其他文件。

存放地点

上述备查文件存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所, 本报告存放在本基金管理人及托管人住所, 供公众查阅、复制。

查阅方式

投资者可免费查阅, 在支付工本费后, 可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件, 相关公开披露的法律文件, 投资者还可在本基金管理人网站(www.fundfunds.com)查阅。