铝河鑫百孚6个月定期开放式证券投资基金2019年第1季度报告

2019-04-16

基金管理人：铝河鑫证券投资有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 16 日

重要提示

铝河鑫百孚6个月定期开放式证券投资基金的管理人铝河鑫证券投资有限公司的董事会，及董事会成员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，但不保证投资一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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基金产品资料概要等。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	铝河鑫百孚6个月定期开放混合
场内简称	
基金主代码	004412
交易代码	004412
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 25 日
报告期末基金份额总额	155,152,155.72 份
投资目标	在有效控制风险的前提下，通过主题行业的优选和适度的波动，通过主动的资产配置，获得稳定产品净值的长期增长，力求在保持基金资产的持续增值。
投资策略	本基金通过对国家经济产配置策略、资金流向产业政策和市场环境的研究，确定基金的资产配置比例，并定期对资产配置比例进行调整和优化调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平低于股票型基金和指数型基金，高于债券型基金。
基金管理人	铝河鑫证券投资有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属两类基金的基金简称	铝河鑫百孚6个月定期开放混合A	铝河鑫百孚6个月定期开放混合C
下属两类基金的交易代码	004412	004413
报告期末下属两类基金的份额总额	154,981,906.82	170,249.12

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 3 月 31 日）	
	铝河鑫百孚6个月定期开放混合A	铝河鑫百孚6个月定期开放混合C
本期已实现收益	3,332,127.72	11,971.90
本期利润	1,415,671.72	1,478.32
加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0072
本期基金资产净值	152,381,306.92	169,213.92
期末基金份额净值	1.0010	1.0010

注：1、本期已实现收益指基金本期利润扣除本期公允价值变动损益后的金额。

2、上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。

基金净值表现

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

阶段	净值增长率标准差①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率标准差③	①-②	②-③
过去三个月	0.11%	0.13%	0.17%	-0.02%	-0.04%

注：1、本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%

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

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	0.10%	0.11%	0.13%	0.17%	-0.03%	-0.06%

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

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	0.10%	0.11%	0.13%	0.17%	-0.03%	-0.06%

注：1、本基金于2018年10月25日成立。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金的投资范围、投资策略和投资限制等各项规定。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同的约定。

基金净值表现

本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

本基金自2018年10月25日至2019年3月31日

本基金自2018年10月25日至2019年3月31日

管理人在报告期内履行职责情况

公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司遵守《证券投资基金管理人内部控制大纲》和《证券投资基金管理人公平交易制度》等有关规定，通过对投资决策、交易执行、交易监控、交易分析等环节的控制措施，对不同投资组合的投资决策和交易执行进行监控，确保公平对待不同投资组合。

报告期内未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司未发现有可能导致基金资产净值发生重大损失的异常交易事项。

报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度金融市场一波三折，1月份在春节前资金面紧张、监管层对于银行理财业务风险关注以及一系列政策不及预期的影响下，股市、债市双双下跌，2月份在春节后资金面宽松、监管层对于银行理财业务风险关注有所缓和、一系列政策不及预期的影响逐渐消退的背景下，股市、债市双双大幅反弹，3月份在资金面宽松、监管层对于银行理财业务风险关注有所缓和、一系列政策不及预期的影响逐渐消退的背景下，股市、债市双双大幅反弹。

本基金在报告期内，在有效控制风险的前提下，通过主题行业的优选和适度的波动，通过主动的资产配置，获得稳定产品净值的长期增长，力求在保持基金资产的持续增值。

报告期内基金的业绩表现

截至本基金本报告期末铝河鑫百孚6个月定期开放混合A基金份额净值为1.0010元，本报告期内，该类别基金份额净值增长率为0.10%，同期业绩比较基准收益率为0.13%；截至本报告期末铝河鑫百孚6个月定期开放混合C基金份额净值为1.0010元，本报告期内，该类别基金份额净值增长率为0.10%，同期业绩比较基准收益率为0.13%。

投资组合报告

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	14,997,600.00	9.57
2	其中：股票	14,997,600.00	9.57
3	固定收益投资	133,986,300.00	85.51
4	其中：债券	133,986,300.00	85.51
5	资产支持证券		
6	贵金属投资		
7	金融衍生品投资		
8	买入返售金融资产		
9	银行存款和结算备付金合计	6,000,000.00	3.83
10	其他各项资产	1,191,111.92	0.76
11	合计	156,175,011.92	100.00

报告期末基金资产组合情况

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	14,997,600.00	9.57
2	其中：股票	14,997,600.00	9.57
3	固定收益投资	133,986,300.00	85.51
4	其中：债券	133,986,300.00	85.51
5	资产支持证券		
6	贵金属投资		
7	金融衍生品投资		
8	买入返售金融资产		
9	银行存款和结算备付金合计	6,000,000.00	3.83
10	其他各项资产	1,191,111.92	0.76
11	合计	156,175,011.92	100.00

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业	225,000.00	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业		
J	金融业	13,329,700.00	8.59
K	房地产业	1,442,900.00	0.93
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
合计		14,997,600.00	9.67

报告期末按行业分类的港股通投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 能源相关		
B 原材料相关		
C 消费相关		
D 金融		
E 医疗保健		
F 工业		
G 信息技术		
H 电信业务		
I 公用事业		
J 房地产		
合计		

注：报告期末基金无应通过港股通投资的境内上市公司股票。

报告期末基金投资前十名股票

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（%）
1	601318	中国平安	194,900	1,709,999.00	1.09
2	600519	贵州茅台	1,900	1,425,000.00	0.91
3	601166	兴业银行	600,000	1,380,000.00	1.32
4	600016	民生银行	300,000	1,176,000.00	0.75
5	601676	鼎通银行	50,000	1,042,000.00	0.67
6	600104	上汽集团	100,000	971,000.00	0.62
7	000001	平安银行	70,000	791,000.00	0.51
8					
9					
10					

注：报告期末基金无应通过港股通投资的境内上市公司股票。

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	国债		
2	其中：政策性金融债		
3	金融债券	97,321,400.00	62.12
4	企业债券	15,164,900.00	9.68
5	可转债	21,499,000.00	13.72
6	中期票据（含短融）		
7	同业存单	100,000.00	0.06
8	其他		
9	合计	133,986,300.00	85.51

报告期末基金投资前五名债券明细

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	113009[注]	广汽转债	200,000	21,792,000.00	13.91
2	101001399	16农发清发债	200,000	20,198,000.00	12.89
3	136470	16中国债	200,000	20,198,000.00	12.89
4	136470	16中国债	200,000	20,198,000.00	12.89
5	101000872	16农商清发债02	200,000	20,004,900.00	12.77

报告期末基金投资的前十名资产支持证券投资组合情况

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

报告期末基金投资的前十名贵金属投资品种情况

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1					

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

报告期末基金投资的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1					

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体被监管机构采取处罚措施的情况说明

本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管机构采取处罚措施的情况。

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中存在被监管机构采取处罚措施的情况说明

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机构采取处罚措施的情况。

其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,000.72
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	1,176,111.20
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	1,191,111.92

报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期内基金投资的前十名证券中没有处于转股期的可转换债券。

报告期内前三名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期内基金投资的前三名股票中不存在流通受限情况。

投资组合报告附注其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占基金资产净值比例与实际比例可能存在尾差。

开放式基金业绩变动

单位：人民币元

项目	铝河鑫百孚6个月定期开放混合A	铝河鑫百孚6个月定期开放混合C
本报告期期初基金份额总额	170,155,964.75	1,724,997.70
本报告期基金总申购份额	1,000,000.00	10,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,173,057.93	1,564,911.78
本报告期期末基金份额总额（份额确认为“0”或“-”填列）		
本报告期基金总赎回份额	155,152,155.72	170,249.12

注：注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、总赎回份额含转换出份额。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

单位：人民币元

基金管理人持有本基金份额变动情况

项目	铝河鑫百孚6个月定期开放混合A	铝河鑫百孚6个月定期开放混合C	铝河鑫百孚6个月定期开放混合C
基金管理人在报告期初持有的基金份额			
报告期间基金管理人申购基金份额			
报告期间基金管理人赎回基金份额			
报告期末基金管理人持有的基金份额			
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）			

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易日期	交易代码	交易类型	交易金额（元）	成交单价
1					

注：本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

影响投资者决策的其他重要信息

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							
报告期间	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
机构	1	20190101 - 20190331	100,000,000.00	0.00	0.00	100,000,000.00	64.45
个人	2	20190101 - 20190331	100,000,721.78	0.00	100,000,721.78	0.00	0.00
产品特有风险							

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%期间，可能发生巨额赎回的风险，基金管理人可能采取延缓支付赎回款项、暂停接受赎回申请或延长赎回款支付日等措施，对基金的流动性带来不利影响，进而可能对基金的资产净值造成影响。

备查文件目录

序号	文件名称	存放地点	查阅方式
1	中国证监会批准设立铝河鑫证券投资有限公司的批准文件	铝河鑫证券投资有限公司	可在营业时间免费查阅
2	铝河鑫百孚6个月定期开放式证券投资基金基金合同		
3	铝河鑫百孚6个月定期开放式证券投资基金托管协议		
4	铝河鑫百孚6个月定期开放式证券投资基金招募说明书		
5	报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告		
6	报告期内在中国证监会指定互联网网站上披露的临时公告		

存放地点

铝河鑫证券投资有限公司营业场所可供查阅。

查阅方式

可在营业时间免费查阅，可复制摘录，可登陆本基金管理人指定网站查阅。

咨询电话：400-1234567890，0931-8321 8888

公司网址：http://www.qclcinvest.com