

华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金

2018 第二季度报告

2018年6月30日

基金管理人: 华富基金管理有限公司
基金托管人: 招商银行股份有限公司
报告送出日期: 2018年7月18日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会及董事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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者应认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件,并自行承担投资风险。
本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者应根据自身情况对基金的投资价值进行判断。
本报告所载资料截止至2018年6月30日,本报告期为2018年4月1日至2018年6月30日。

1.2 基金产品概况

基金名称	华富弘鑫灵活配置混合
交易代码	001822
基金运作方式	契约封闭式
基金合同生效日期	2016年11月28日
报告期末基金份额总额	407,433,148.13份
投资目标	本基金通过积极主动的资产配置,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金份额净值的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过自上而下的资产配置策略,同时结合自下而上的行业配置策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。本基金采取分散投资,严格控制个股持仓比例,严格控制行业集中度,严格控制基金资产在权益类资产上的投资比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于纯债券基金,低于股票型基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
基金销售机构	华富基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、华富弘鑫基金销售有限公司
下属基金销售机构的名称	001822 001823
报告期末下属基金的销售份额	1,580,664,088.17 401,292,783,135.01

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	23,548,642	6,609.45
2.本期利润	34,296,206	14,290.18
3.期末可供分配利润	6,007.91	0.0063
4.期末未分配利润	4,830,955.28	2,285,305.35
5.期末基金份额净值	1.149	1.130

3.2 基金净值表现

基金名称	净值增长率	业绩比较基准	超额收益
华富弘鑫灵活配置混合	0.87%	0.05%	-0.29%
沪深300指数	0.75%	0.75%	0.00%
上证国债指数	0.51%	0.51%	0.00%



4.1 基金投资组合报告

4.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	债券投资	512,859,202.00	97.29
3	买入返售金融资产	510,234,262.00	96.89
4	银行存款	2,155,000.00	0.41
5	其他资产	-	-
6	其他负债	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	6,883,992.01	1.31
10	合计	527,148,981.01	100.00

4.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
制造业	29,799,000.00	7.13
其他行业	29,799,000.00	7.13
合计	29,799,000.00	7.13

4.1.3 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

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	11811105	中国平安	600,000	57,584,000.00	13.57
2	000415	招商局港口	400,000	39,424,000.00	9.56
3	000027	华发股份	400,000	39,552,000.00	9.48
4	130271	招商局港口	400,000	39,172,000.00	9.32
5	130623	招商局港口	400,000	39,072,000.00	9.33

4.1.4 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170904	17国债04	100,000	2,110,000.00	0.51

4.1.5 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150001	15上证国债01	1,215,000.00	21,275,000.00	5.09

4.2 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.3 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.4 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.5 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.6 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.7 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.8 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.9 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.10 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

华富恒稳纯债债券型证券投资基金

2018 第二季度报告

2018年6月30日

基金管理人: 华富基金管理有限公司
基金托管人: 招商银行股份有限公司
报告送出日期: 2018年7月18日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会及董事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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者应认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等文件,并自行承担投资风险。
本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者应根据自身情况对基金的投资价值进行判断。
本报告所载资料截止至2018年6月30日,本报告期为2018年4月1日至2018年6月30日。

1.2 基金产品概况

基金名称	华富恒稳纯债
交易代码	000808
基金运作方式	契约封闭式
基金合同生效日期	2014年12月17日
报告期末基金份额总额	62,117,474.28份
投资目标	在严格控制风险和保持流动性的基础上,追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下的资产配置策略,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。本基金采取分散投资,严格控制个股持仓比例,严格控制行业集中度,严格控制基金资产在权益类资产上的投资比例。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的债券型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
基金销售机构	华富基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、华富恒稳基金销售有限公司
下属基金销售机构的名称	000808 000809
报告期末下属基金的销售份额	4,118,474.28 3,822,998.52份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年4月1日至2018年6月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	23,548,642	6,609.45
2.本期利润	34,296,206	14,290.18
3.期末可供分配利润	6,007.91	0.0063
4.期末未分配利润	4,830,955.28	2,285,305.35
5.期末基金份额净值	1.149	1.130

3.2 基金净值表现

基金名称	净值增长率	业绩比较基准	超额收益
华富恒稳纯债	0.79%	0.08%	-0.16%
中证全债指数	0.07%	0.07%	0.00%
上证国债指数	0.51%	0.51%	0.00%



4.1 基金投资组合报告

4.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	债券投资	57,903,800.00	13.19
3	买入返售金融资产	57,903,800.00	13.19
4	银行存款	3,136,936.00	0.94
5	其他资产	-	-
6	其他负债	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	118,044,536.00	26.12

4.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
制造业	3,136,936.00	0.94
其他行业	3,136,936.00	0.94
合计	3,136,936.00	0.94

4.1.3 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

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	11811105	中国平安	600,000	57,584,000.00	13.57
2	000415	招商局港口	400,000	39,424,000.00	9.56
3	000027	华发股份	400,000	39,552,000.00	9.48
4	130271	招商局港口	400,000	39,172,000.00	9.32
5	130623	招商局港口	400,000	39,072,000.00	9.33

4.1.4 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170904	17国债04	100,000	2,110,000.00	0.51

4.1.5 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150001	15上证国债01	1,215,000.00	21,275,000.00	5.09

4.2 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.3 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.4 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.5 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.6 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.7 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.8 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.9 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.10 基金管理人运用基金资产进行证券投资的情况

报告期末基金资产组合	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
股票投资	7,334,110.90	401,655,788.81
债券投资	1,493,445.92	41,005.67
买入返售金融资产	5,840,648.08	401,922,783.13

4.3.1 公平交易制度的执行情况
基金管理人严格按照中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场、二级市场交易的研究、决策、执行、反馈等环节进行了全面规范,并建立了公平交易制度的执行流程,确保公平交易制度的有效执行。
4.3.2 异常交易行为的监控
本报告期内未发现异常交易行为。
4.4 报告期内基金管理人参与融资融券业务的情况
本报告期内,公司未发生融资融券业务。
4.5 基金管理人参与股指期货交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生股指期货交易。
4.6 基金管理人参与国债期货交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生国债期货交易。
4.7 基金管理人参与权证交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生权证交易。
4.8 基金管理人参与股指期货交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生股指期货交易。
4.9 基金管理人参与国债期货交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生国债期货交易。
4.10 基金管理人参与权证交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生权证交易。

4.3.2 异常交易行为的监控
本报告期内未发现异常交易行为。
4.4 报告期内基金管理人参与融资融券业务的情况
本报告期内,公司未发生融资融券业务。
4.5 基金管理人参与股指期货交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生股指期货交易。
4.6 基金管理人参与国债期货交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生国债期货交易。
4.7 基金管理人参与权证交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生权证交易。
4.8 基金管理人参与股指期货交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生股指期货交易。
4.9 基金管理人参与国债期货交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生国债期货交易。
4.10 基金管理人参与权证交易的情况
2018年1-3季度,公司未发生权证交易。

4.5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	债券投资	9,200,643.10	96.10
3	买入返售金融资产	9,200,643.10	96.10
4	银行存款	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他负债	-	-
7	资产减值准备	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,200,643.10	100.00

4.5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
制造业	-	-
其他行业	-	-
合计	-	-

4.5.2 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

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	000001	平安银行	9,200,643.10	100.00	100.00

4.5.3 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170904	17国债04	9,200,643.10	100.00	100.00

4.5.4 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150001	15上证国债01	9,200,643.10	100.00	100.00