华富量子生命力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:华富基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2019年4月1日至2019年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富量子生命力混合
基金主代码	410009
交易代码	410009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月1日
报告期末基金份额总额	57,050,744.89份
投资目标	本基金主要采用数量化投资方法,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金从市场估值的驱动因素出发进行资产配置,通过寻找与市场走势相关性最大的因子组合,构建市场趋势预测模型,对市场未来1-3个月整体估值水平进行预测,实现基金在股票、债券及现金之间的合理配置。本基金采用行下向上的选股策略,关于组合个股精选以及行业优化的分析数量化投资模式。主要投资于综合资质优良、价值相对低估、能为股东创造持续稳健回报的公司。选股模型严格遵循“价值投资”理念,围绕价值和价格两大因素,通过公司资质和估值情绪双层筛选机制,逐级筛选股票,并最终确定股票投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§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	2,301,486.12
2.本期利润	-2,248,775.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0393
4.期末基金资产净值	50,907,506.60
5.期末基金份额净值	0.8923

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

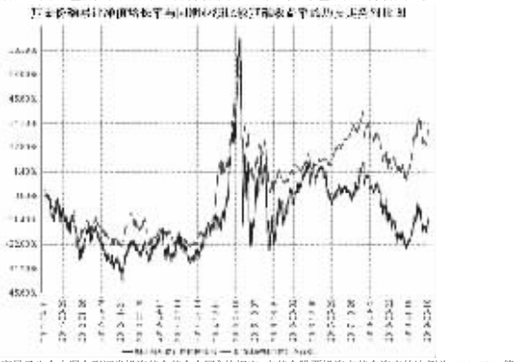
3.2 基金净值表现

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

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	-4.25%	1.31%	-0.61%	1.14%	-3.64%	0.17%

注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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:根据《华富量子生命力混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%,债券、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具占基金资产的0%-40%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,基金保留的现金以及投资于到期日一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2011年4月1日到2011年10月1日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富量子生命力混合型证券投资基金基金合同》的规定。

§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		
龚玲	华富量子生命力混合型基金基金经理,华富安心月比选混合型基金基金经理,华富成长趋势混合型基金基金经理,华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理,华富国泰民安灵活配置混合型基金基金经理,华富天源灵活配置混合型基金基金经理,华富天鹅灵活配置混合型基金基金经理,华富智联共享灵活配置混合型基金基金经理,华富智联世界灵活配置混合型基金基金经理,公司公募投资决策委员会主席,公司副总经理	2017年9月12日	-	十五年	安徽财经大学金融学硕士,研究生学历,历任西部证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理高级总经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监。2012年9月加入华富基金管理有限公司,曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理。2014年8月7日至2015年2月11日任华富灵活配置混合型基金基金经理。2018年7月27日至2018年12月21日任华富元鑫灵活配置混合型基金基金经理。
郦彤	华富量子生命力混合型基金基金经理,研究发展部总监、公募投资决策委员会委员	2019年6月10日	-	十四年	复旦大学金融学博士,博士研究生学历,曾任中国国际金融股份有限公司策略分析师、宏源证券股份有限公司首席策略分析师、中信证券股份有限公司首席策略分析师、国信证券股份有限公司首席策略分析师。2017年4月加入华富基金管理有限公司。

注:这里的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本报告期内,本基金管理人在勤勉尽责的原则下,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,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》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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,国内实体经济仍在下行趋势中,中美贸易战一波三折。从经济周期的角度看,社会信用环境逐渐边际改善,今年前5个月社融增速规模余额增速回升至10.6%,已经处于企稳回升区间;PMI等领先景气度指标尚未显疲弱,4、5两个月制造业PMI连续处于荣枯线下方,工业增加值与企业利润增速也均处于放缓趋势中,实体企业库存也在继续去化。总体看,整体宏观经济仍处在信用环境缓和、但尚未传导到实体企业生产的状态。

国际方面,全球重要经济体均出处在经济下行趋势中,一季度经济韧性超预期的美国在二季度末开始频繁出现经济数据低于预期的情况,6月美联储FOMC会议明确释放出鸽派信号,美联储进入降息周期的脚步渐行渐近,全球宽松环境预计可以持续。中美贸易战方面,5月中美贸易谈判突然出现显著恶化,而在6月底G20峰会上则再次出现边际缓和,显示双方对于达成协议均有诉求,而两国贸易与产业摩擦会是长期的矛盾。

政策方面,4月中央政治局会议基调由宽变紧,而在二季度经济数据再次走弱、包商银行事件爆发后,央行对银行间市场流动性持续呵护。资本市场政策政策方面,6月科创板企业陆续开始招股询价,科创板注册制立开序幕。

2019年二季度,沪深300指数累计下跌1.21%,创业板指累计下跌10.75%。市场在一季度大幅反弹之后出现明显回落,主要因素包括中美贸易战的反复、国内货币政策基调微调等。从二季度看,相对表现最好的三个行业为食品饮料、家电、银行,表现最差的三个行业为传媒、综合、轻工制造。

量子生命力主要遵循的是量化选股的投资方法,适当辅助了从行业与公司基本面角度出发的主动行业配置和选股策略。本基金二季度持仓中重点配置行业包括医药、科技、机械等。医药板块符合高ROE高成长量化策略的选股结果,且在经济企稳过渡期内具备防御性。医药行业是为数不多增长确定性较高的行业之一,考虑到医药板块受国家医保控费政策的影响,我们更多选择了药房、连锁医疗服务、消费品牌中药等非药子行业领域的龙头公司进行配置。我们还看好科技板块,TMT板块在5G、物联网、云计算、自主可控等催化因素的推动下,成长性毋庸置疑,我们对其中龙头股公司加大了配置比例。机械板块也成为我们一季度的重点配置方向,理由是新兴行业设备、例如锂电设备、半导体设备、物流装备等景气度受益于国家政策持续上升,受宏观经济带来需求下滑的影响有限。

展望下半年,宏观环境仍处于衰退期向复苏期转换的过渡期,围绕中美贸易战的反复仍将继续,国内宏观政策选择上需要在稳增长与深化改革开放之间寻求平衡,而海外市场随着美国经济转弱、降息预期、股市波动加大等因素更添变数,因此,A股市场仍将以震荡行情为主,寻求结构性的投资机会仍将是主要投资策略。以“科创板”为契机,大力发展直接融资,全面提升证券市场服务实体经济的能力,在此大背景下,股市的系统性风险较为有限,需重点关注“科创板”为导向的国家重点鼓励和支持的产业。

未来我们在遵循量化选股的基本投资方法基础上,会适当增加行业及风格的主动选择配置的因素,加强了对个股的研究,以规避市场不利状况下的波动风险,不断优化我们的投资组合,为投资者提供更稳健增长的收益。

从行业配置角度来看,遵循投资时钟,目前配置的重点将继续集中在消费和科技两大板块。继续从基本面角度出发,努力发掘盈利增长确定性高具备长期投资价值的龙头公司来进行配置,而并不追逐市场的短期热点和主题,或者补涨品种。我们看好的投资主线是:首先,寻找尽管整体经济下行周期下,但受益于国家扶持政策或者本身行业景气度向上的行业,包括医疗信息化、云计算、半导体、新能源、物流自动化等;其次,对于目前配置较多的“市场抱团”的主要消费类龙头企业,结合即将到来的中报披露情况进行细致甄别,减持那些成长性不佳值相比空间有限的公司;最后,量化选股下的坚持高股息策略,例如公用事业等板块,依然可以给组合提供一定的绝对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同2011年4月1日生效,截止2019年6月30日,本基金份额净值为0.8923元,累计份额净值为0.8923元。本报告期,本基金份额净值增长率为-4.25%,同期业绩比较基准收益率为-0.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从2019年5月6日起至2019年6月19日,本基金基金资产净值存在连续二十个工作日低于五千万元的情形,至本报告期期末(2019年6月30日)本基金已不存在基金资产净值低于五千万元的情形。

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§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	39,173,607.88	75.51
	其中:股票	39,173,607.88	75.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,127,321.66	6.03
	其中:债券	3,127,321.66	6.03
	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	9,481,825.22	18.28
8	其他资产	96,634.05	0.19
9	合计	51,879,388.81	100.00

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

代码	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	2,844,864.00	5.59
C	制造业	21,201,382.00	41.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,792,485.00	7.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,826,439.00	5.55
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	3,688,053.00	7.24
J	金融业	2,949,495.70	5.79
K	房地产业	488,708.00	0.96
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	1,382,181.18	2.72
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,173,607.88	76.95

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通股投资股票。

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

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	603986	兆易创新	35,940	3,115,998.00	6.12
2	600273	嘉化能源	239,500	2,768,620.00	5.44
3	300450	先导智能	73,900	2,483,040.00	4.88
4	002439	启明星辰	75,300	2,025,570.00	3.98
5	600276	恒瑞医药	29,280	1,932,480.00	3.80
6	600036	招商银行	53,665	1,930,866.70	3.79
7	601857	中国石油	274,800	1,890,624.00	3.71
8	002422	科伦药业	58,400	1,736,232.00	3.41
9	002049	紫光国微	34,100	1,504,151.00	2.95
10	002697	红旗连锁	232,400	1,503,628.00	2.95

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	2,402,400.00	4.72
	其中:政策性金融债	2,402,400.00	4.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	724,921.66	1.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,127,321.66	6.14

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	108901	农发1801	24,000	2,402,400.00	4.72
2	128030	天康转债	5,000	581,500.00	1.14
3	128061	启明转债	879	97,604.16	0.19
4	110041	蒙电转债	410	45,817.50	0.09

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股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 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

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,734.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,124.87
5	应收申购款	2,774.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,634.05

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128030	天康转债	581,500.00	1.14
2	110041	蒙电转债	45,817.50	0.09

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告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

报告期初基金份额总额	57,788,112.22
报告期期间基金总申购份额	701,391.97
减:报告期期间基金总赎回份额	1,438,759.30
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	57,050,744.89

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	40,612,151.56
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	40,612,151.56
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	71.19

注:基金管理人投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定,符合公允性要求,申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。赎回卖出总份额里包含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§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	4.1-6.30	40,612,151.56	0.00	0.00	40,612,151.56	71.19%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品持有风险							
无							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、华富量子生命力混合型证券投资基金基金合同

2、华富量子生命力混合型证券投资基金托管协议

3、华富量子生命力混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富量子生命力混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富天盈货币市场基金

2019 第二季度 报告

2019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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2019年4月1日至2019年6月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富天盈货币	
基金主代码	004285	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月3日	
报告期末基金份额总额	116,251,071.56份	
投资目标	在控制投资组合风险,保持流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金在保持组合高流动性的前提下,结合对国内外宏观经济走行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法,发现和捕捉市场的机会,实现基金的投资目标。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富天盈货币A	华富天盈货币B
下属分级基金的交易代码	004285	004286
报告期末下属分级基金的份额总额	1,142,687.05份	115,108,384.51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)		
		华富天盈货币A	华富天盈货币B
1.本期已实现收益	8,837.51	638,924.10	
2.本期利润	8,837.51	638,924.10	
3.期末基金资产净值	1,142,687.05	115,108,384.51	

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

华富天盈货币A

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	0.5014%	0.0011%	0.3366%	0.0000%	0.1648%	0.0011%

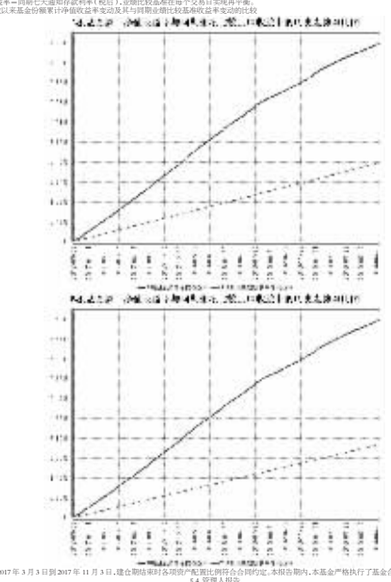
注:业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率(税后),业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

华富天盈货币B

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	0.5621%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.2255%	0.0010%

注:业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率(税后),业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:本基金建仓期为2017年3月3日到2017年11月3日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了基金合同的相关规定。

§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		
倪莉莎	华富天盈货币市场基金基金经理,华富恒财定期开放债券型基金基金经理,华富恒丰3个月定期开放债券型基金基金经理,华富恒瑞3个月定期开放债券型发起式基金基金经理,华富弘鑫灵活配置混合型基金基金经理,华富恒盛纯债债券型基金基金经理,华富恒泰纯债债券型基金基金经理	2017年9月12日	-	五年	英国曼彻斯特大学管理学硕士,研究生学历。2014年2月加入华富基金管理有限公司,先后担任集中交易部助理交易员、交易员,固定收益部华富货币市场基金、华富天益货币市场基金、华富益鑫灵活配置混合型基金、华富恒财定期开放债券型基金基金经理。2018年6月25日至2019年3月28日任华富恒悦定期开放债券型基金基金经理。
姚欣悦	华富天益货币市场基金基金经理,华富恒裕纯债债券型基金基金经理,华富恒富18个月定期开放债券型基金基金经理,华富恒悦纯债债券型基金基金经理	2017年3月14日	2019年6月20日	七年	复旦大学金融学硕士,研究生学历,先后任职于广发银行股份有限公司、上海农商银行股份有限公司,2016年11月加入华富基金管理有限公司,2017年3月14日至2019年6月20日任华富天盈货币市场基金基金经理。2017年1月4日至2019年6月20日任华富货币市场基金基金经理。

注:这里的任职日期,离任日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行,本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况,相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,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》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在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

本报告期内,本基金管理人在勤勉尽责的原则下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略:本基金在保持组合高流动性的前提下,结合对国内外宏观经济走行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析,合理安排组合期限结构,积极选择投资工具,采取主动性的投资策略和精细化的操作手法,发现和捕捉市场的机会,实现基金的投资目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2017年3月3日正式成立。二季度华富天盈货币A类基金份额净值收益率为0.5014%,期间业绩比较基准为0.3366%,期间年化收益率2.0066%。华富天盈货币B类基金份额净值收益率为0.5621%,期间业绩比较基准0.3366%,期间年化收益率2.2482%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金净值预警说明

从2018年10月29日起至本报告期末(2019年6月30日),本基金持有人数存在连续六个工作日不满二百人的情形,至本报告期期末(2019年6月30日)本基金持有人数仍不满二百人,本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》,积极采取相关措施,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	65,342,721.98	51.56
	其中:债券	65,342,721.98	51.56
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	29,500,404.25	23.28
	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	30,992,904.34	24.45
4	其他资产	900,227.06	0.71
5	合计	126,736,257.63	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	4.75
	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金额	10,357,794.97 / 8.91
	其中:买断式回购融资	- / -

债券正回购的资金金额超过基金资产净值的20%的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金金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	46
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	36

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分项比例

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	43.87	8.91
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	34.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	12.90	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	12.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	4.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		108.68	8.91

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

注:本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过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	499,232.44	0.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,034,601.88	8.63
	其中:政策性金融债	5,017,717.83	4.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	15,000,248.97	12.90
6	中期票据	-	-
7	同业存单	39,808,638.69	34.24
8	其他	-	-
9	合计	65,342,721.98	56.21
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和溢折价。

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	071900043	19浮息证券C3002	100,000	10,000,248.97	8.60
2	111816252	18上海银行CD252	100,000	9,968,399.61	8.57
3	111921164	19浦银行CD164	100,000	9,962,504.70	8.57
4	111812174	18北京银行CD174	100,000	9,955,352.72	8.56
5	111914014	19工行银行CD014	100,000	9,932,381.66	8.54
6	1622018	16国债贴息债01	50,000	5,016,884.05	4.32
7	071900046	19浦海证券C9006	50,000	5,000,000.00	4.30
8	108901	农发1801	30,000	3,000,805.55	2.58
9	170205	17国开05	20,000	2,016,912.28	1.73
10	019611	19国债01	5,000	499,232.44	0.43

5.7 “摊子定价”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	0.0494%
报告期内偏离度的最低值	-0.0213%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0099%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:报告期内不存在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

注:报告期内不存在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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值、基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入或本构示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期期内按实际利率法进行摊销,每日计提收益或损失。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	452.59
2	应收证券清算款	504,857.45
3	应收利息	394,917.02
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	900,227.06

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额