# 财通聚利纯债债券型证券投资基金

## 2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:江苏银行股份有限公司
报告送出日期:2019 年 07 月 18 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。
基金托管人江苏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。
本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 财通聚利债券 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 005853 |
| 交易代码 | - |
| 基金运作方式 | 契约型,开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年 09 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 498,250,541.62 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的稳健回报。 |
| 投资策略 | 本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响,本基金注重组合的流动性,在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,自上而下确定大类债券资产配置和信用债券类属配置,动态调整组合久期和信用债券的结构,依然坚持自下而上精选个券的策略,在获取持有期收益的基础上,优化组合的流动性。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合(全价)指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型基金,其预期风险与收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的中低风险、中低收益品种。 |
| 基金管理人 | 财通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 江苏银行股份有限公司 |

§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 04 月 01 日 - 2019 年 06 月 30 日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 5,373,111.54 |
| 2.本期利润 | 4,923,831.88 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0099 |
| 4.期末基金资产净值 | 509,232,015.70 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0220 |

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。

3.2 基金净值表现

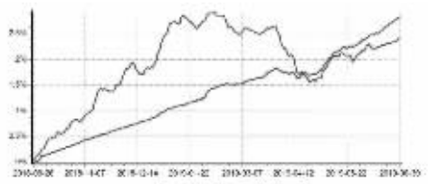
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.97% | 0.03% | -0.24% | 0.06% | 1.21% | -0.03% |

注:(1)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;
(2)本基金业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率。

3.2.2 自基金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

财通聚利纯债债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018 年 9 月 26 日-2019 年 6 月 30 日)



注:(1)本基金合同生效日为 2018 年 9 月 26 日,基金合同生效起至披露时点不满一年;
(2)根据《基金合同》规定:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%;本基金持有的现金以及到期日在 1 年以内的政府债券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。本基金建仓期是 2018 年 9 月 26 日至 2019 年 3 月 26 日,截至报告期末及建仓期末,本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

§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 | | |
| 罗晓倩 | 本基金的基金经理 | 2018年 9 月 26 日 | - | 6年 | 复旦大学投资学研究生。先后就职于友邦保险、国华人寿、汇添富基金、华福基金,2015 年 5 月加入东吴证券担任资产管理总部投资经理,2016 年 5 月加入财通基金管理有限公司,担任固定收益部基金经理助理,2017 年 7 月起任基金经理。 |
| 林洪钧 | 本基金的基金经理,固定收益投资总监兼固定收益部总监 | 2018年 9 月 26 日 | - | 14年 | 复旦大学工商管理硕士,力学与工程科学本科,历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理,华安基金管理有限公司债券交易员,加拿大 financial Engineering Source Inc.金融研究员,交银施罗德基金管理有限公司固定收益部债券研究员、专户投资部投资经理、固定收益部助理总经理/基金经理,光大保德信基金管理有限公司固定收益部固定收益投资总监、兴证证券资产管理有限公司固定收益投资三部副收总监,2018 年 8 月加入财通基金管理有限公司,现任公司固定收益投资总监兼固定收益部总监。 |

注:(1)基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;
(2)非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;
(3)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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人以价值投资为理念,致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系,营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系,确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易,并建立了公平的交易分配制度,确保在场内、场外各类交易中,各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时,公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库,在此平台上共享研究成果,并对各组合提供无倾向性支持;在公用备选库的基础上,各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库,进而根据投资授权权建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上,形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度,并在交易系统中适当启用公平交易模块,保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节,特殊情况会经过严格的报告和审批程序,会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析,以排查异常交易。

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《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定,未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库,在此平台上共享研究成果,并对各组合提供无倾向性支持;在公用备选库的基础上,各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库,进而根据投资授权权建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上,形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度,并在交易系统中适当启用公平交易模块,保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节,特殊情况会经过严格的报告和审批程序,会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析,以排查异常交易。

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《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定,未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易(短期国债回购交易除外)的情况,也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控,以及事后的统计排查,本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明,本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响,亦未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内经济动能仍偏弱,经济继续处于下行通道,生产需求双弱格局未改。房地产下行走势明确且当前限产对生产不利,基建将反弹但预计反弹幅度有限。

货币政策层面,包商事件引发的实体融资压力尚未得到缓解,当前不具备货币政策收紧的前提。在经济数据持续偏弱的大背景下,货币政策在趋势上难以收紧。海外方面,美德收益率曲线倒新低,对国内债市而言,随着贬值预期与资本外流压力的有效释放,整体利好国内债券市场。

本报告期内,本基金在报告期内降低风险偏好,重点配置高评级债券。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,财通聚利债券基金份额净值为 1.0220 元,本报告期内,基金份额净值增长率为 0.97%,同期业绩比较基准收益率为 -0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未有连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情况出现。

§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 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 438,118,850.00 | 85.98 |
| | 其中:债券 | 402,443,850.00 | 78.98 |
| | 资产支持证券 | 35,675,000.00 | 7.00 |
| 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 | 35,107,517.39 | 6.89 |
| 8 | 其他资产 | 36,303,444.84 | 7.12 |
| 9 | 合计 | 509,529,812.23 | 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
本基金本报告期未未持有股票。
5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期未未持有通过港股通机制投资的港股。
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
本基金本报告期未未持有股票。
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 | 198,483,400.00 | 38.98 |
| | 其中:政策性金融债 | 150,910,000.00 | 29.63 |
| 4 | 企业债券 | 131,592,100.00 | 25.84 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 72,368,350.00 | 14.21 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 402,443,850.00 | 79.03 |

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 | 170206 | 17国开 06 | 500,000 | 50,995,000.00 | 10.01 |
| 2 | 180312 | 18进出 12 | 500,000 | 50,080,000.00 | 9.83 |
| 3 | 1880213 | 18朔州债 01 | 480,000 | 50,011,200.00 | 9.82 |
| 4 | 190202 | 19国开 02 | 500,000 | 49,835,000.00 | 9.79 |
| 5 | 155981 | 18云投 Y1 | 490,000 | 49,161,700.00 | 9.65 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 149678 | 青山湖 04 | 250,000 | 25,590,000.00 | 5.03 |
| 2 | 156144 | 大型 9A | 250,000 | 10,085,000.00 | 1.98 |

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
本基金本报告期未未持有贵金属。
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
本基金本报告期未未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金不投资股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金暂不投资国债期货。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的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 | 18,227.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | 698,082.19 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,021,546.04 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 28,565,589.04 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 36,303,444.84 |

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中不在在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不在在流通受限情况。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,本报告中涉及比例计算的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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 501,847,734.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 3,597,192.58 |
| 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 | 498,250,541.62 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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
本基金管理人未运用固有资金投资本基金。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金明细
本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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
报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况发生。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内,公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《证券时报》及管理人网站进行了如下信息披露:
1.报告期内,公司按照《信息披露管理办法》的规定,在《证券时报》及管理人网站进行了"视觉中国"股票估值方法的公告;
2.报告期内,公司按照《信息披露管理办法》的规定,在《证券时报》及管理人网站进行了关于上海农村商业银行股份有限公司暂停代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告;
3.本报告期内,公司按照《信息披露管理办法》的规定每日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.中国证监会核准基金募集的文件;
2.财通聚利债券型证券投资基金合同;
3.财通聚利债券型证券投资基金托管协议;
4.财通聚利债券型证券投资基金招募说明书及其更新;
5.基金管理人业务资格批件、营业执照;
6.基金托管人业务资格批件、营业执照;
7.报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点
上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 41 楼。

9.3 查阅方式
投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。
投资者对本报告如有疑问,可咨询本管理人。
咨询电话:400-820-9888
公司网址:http://www.ctfund.com。

财通基金管理有限公司
二〇一九年七月十八日

# 财通新兴蓝筹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:财通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019 年 07 月 18 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。
基金托管人中国工商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。
本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 财通新兴蓝筹混合 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 006822 |
| 交易代码 | - |
| 基金运作方式 | 契约型,开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019年 02 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 239,178,031.80 份 |
| 投资目标 | 本基金重点投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司,在有效控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果。 |
| 投资策略 | 本基金所指的新兴蓝筹主题相关证券,是指处于企业成长期,成长性确定,代表中国经济结构转型方向,在细分行业中占有领先地位,市场份额增长空间大,业绩良好且稳定增长,估值相对低估的监筹公司股票。本基金将重点关注上市公司的成长性指标,包括收入增速、净利润增长机遇、行业未来成长空间或竞争格局等因素,股票投资策略上,本基金在个股选择上,依照新兴蓝筹公司所具备的特征,自下而上精选具有核心竞争力、经营稳健、业绩优良、治理结构健康、持续分红能力较强的公司股票和通投资组合;同时通过内地与香港股票市场交易互联机制投资于香港股票市场。债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用风险管理和利息策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益;本基金将在严格控制风险的前提下进行权益投资;本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货交易,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货交易时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率 ×25% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金,低于股票型基金产品,属于中高风险、中高收益的基金产品。 |
| 基金管理人 | 财通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§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 04 月 01 日 - 2019 年 06 月 30 日) | |
|---|---|---|
| | 财通新兴蓝筹混合 A | 财通新兴蓝筹混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -386,854.14 | -289,948.81 |
| 2.本期利润 | -575,034.29 | -292,290.53 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0030 | -0.0032 |
| 4.期末基金资产净值 | 174,198,759.65 | 65,291,556.85 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0020 | 0.9993 |

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。

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
财通新兴蓝筹混合 A 净值表现

| 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 | 0.11% | 1.08% | -0.59% | 1.15% | 0.70% | -0.07% |

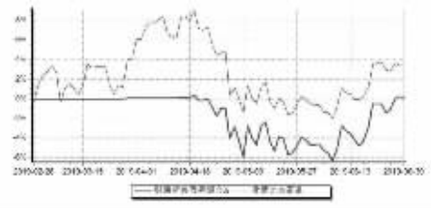
注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;
(2)本基金业绩比较基准为:本基金业绩比较基准:沪深 300 指数收益率 *75%+ 上证国债指数收益率 *25%。
财通新兴蓝筹混合 C 净值表现

| 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% | 1.08% | -0.59% | 1.15% | 0.49% | -0.07% |

注:(1)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;
(2)本基金业绩比较基准为:本基金业绩比较基准:沪深 300 指数收益率 *75%+ 上证国债指数收益率 *25% 。

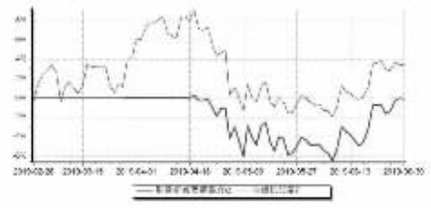
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通新兴蓝筹混合型证券投资基金 A
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019 年 02 月 28 日-2019 年 06 月 30 日)



注:(1)本基金合同生效日为 2019 年 2 月 28 日,基金合同生效起至披露时点不满一年;
(2)根据《基金合同》规定:本基金投资投资占基金资产的比例为 60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%),投资于新兴蓝筹主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金建仓期是 2019 年 2 月 28 日至 2019 年 8 月 28 日,截至报告期末,本基金处于建仓期,本基金的资产配置将在建仓期末符合基金契约的相关要求。

财通新兴蓝筹混合型证券投资基金 C
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019 年 02 月 28 日-2019 年 06 月 30 日)



注:(1)本基金合同生效日为 2019 年 2 月 28 日,基金合同生效起至披露时点不满一年;
(2)根据《基金合同》规定:本基金投资投资占基金资产的比例为 60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%),投资于新兴蓝筹主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金建仓期是 2019 年 2 月 28 日至 2019 年 8 月 28 日,截至报告期末,本基金处于建仓期,本基金的资产配置将在建仓期末符合基金契约的相关要求。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2019 年上半年 A 股出现了重大变化,四月市场延续了前期的上涨,但是五月由于特朗普的反水,贸易战的形势突然恶化,市场出现了持续下跌。面对这一变化,我们的判断是贸易战只是市场上涨过程中的一个扰动因素,但是投资的结构可能性在位更为重要,考虑到本基金的成立时点,成立初期我们相对保守,等到了市场因为贸易战大幅下跌才显著提高了仓位,在二季度市场下跌的过程中,净值基本保持了持平。本基金重点投资了一些需求稳定、公司优质的细分行业,例如医疗服务、创新药、新兴消费、云计算、5g 等有。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末财通新兴蓝筹混合 A 基金份额净值为 1.0020 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为 0.11%,同期业绩比较基准收益率为 -0.59%;截至报告期末财通新兴蓝筹混合 C 基金份额净值为 0.9993 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为 -0.10%,同期业绩比较基准收益率为 -0.59%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
报告期内,本基金未有连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情况出现。

§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 | 187,176,955.13 | 77.92 |
| | 其中:股票 | 187,176,955.13 | 77.92 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 52,957,058.71 | 22.05 |
| 8 | 其他资产 | 68,348.17 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 240,202,362.01 | 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 | 128,737.20 | 0.05 |
| C | 制造业 | 117,122,381.23 | 48.90 |
| 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 | 9,447,313.00 | 3.94 |
| 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 | 18,048,588.96 | 7.54 |
| J | 金融业 | 17,093,053.00 | 7.14 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 5,239,215.00 | 2.19 |
| 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 | 20,097,666.74 | 8.39 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 187,176,955.13 | 78.16 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期未未持有通过港股通机制投资的港股。
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 | 002044 | 美年健康 | 1,061,459 | 13,204,549.96 | 5.51 |
| 2 | 300059 | 东方财富 | 958,184 | 12,983,393.20 | 5.42 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 188,500 | 10,367,500.00 | 4.33 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 10,000 | 9,840,000.00 | 4.11 |
| 5 | 601933 | 永辉超市 | 925,300 | 9,447,313.00 | 3.94 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 362,693 | 8,991,159.47 | 3.75 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 238,400 | 8,577,632.00 | 3.58 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 96,100 | 8,515,421.00 | 3.56 |
| 9 | 603833 | 欧派家居 | 77,200 | 8,308,264.00 | 3.47 |
| 10 | 600486 | 扬农化工 | 136,597 | 7,471,855.90 | 3.12 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期未未持有债券。
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
本基金本报告期未未持有债券。
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
本基金本报告期未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
本基金本报告期未未持有贵金属。
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
本基金本报告期未未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金暂不投资国债期货。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货合约。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 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。
根据公开信息,本基金投资的前十名证券发行主体(证券代码:000681)全资子公司汉华易美(天津)图像技术有限公司收到天津市互联网信息办公室行政处罚决定书《津网信罚决字【2019】第 1 号》。
5.11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的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 | 51,420.85 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,930.32 |
| 5 | 应收申购款 | 6,997.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 68,348.17 |

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,本报告中涉及比例计算的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

| | 财通新兴蓝筹混合 A | 财通新兴蓝筹混合 C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 212,409,029.52 | 199,034,172.42 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,080,466.63 | 206,472.19 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 39,646,886.79 | 133,905,222.17 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 173,842,609.36 | 65,335,422.44 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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
本基金管理人未运用固有资金投资本基金。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金明细
本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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
报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况发生。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内,公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《证券时报》及管理人网站进行了如下信息披露:
1.报告期内,公司按照《信息披露管理办法》的规定,在《证券时报》及管理人网站进行了"视觉中国"股票估值方法的公告;
2.报告期内,公司按照《信息披露管理办法》的规定,在《证券时报》及管理人网站进行了关于上海农村商业银行股份有限公司暂停代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告;
3.本报告期内,公司按照《信息披露管理办法》的规定每日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.中国证监会核准基金募集的文件;
2.财通新兴蓝筹混合型证券投资基金合同;
3.财通新兴蓝筹混合型证券投资基金托管协议;
4.财通新兴蓝筹混合型证券投资基金招募说明书;
5.基金管理人业务资格批件、营业执照;
6.基金托管人业务资格批件、营业执照;
7.报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点
上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 41 楼。

9.3 查阅方式
投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。
投资者对本报告如有疑问,可咨询本管理人。
咨询电话:400-820-9888
公司网址:http://www.ctfund.com。

财通基金管理有限公司
二〇一九年七月十八日

# 财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)

## 2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019 年 07 月 18 日

§1 重要提示

基