华富安享债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
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2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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2018年1月1日起至2018年6月30日止。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金名称	华富安享债券型证券投资基金
基金简称	华富安享债券
基金主代码	002280
交易代码	002280
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年1月30日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	52,816,829.84份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况(转型前)

基金名称	华富安享保本混合型证券投资基金
基金简称	华富安享保本混合
基金主代码	002280
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月21日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	130,578,445.47份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求较高的当期收益和长期回报,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以久期和流动性管理作为债券投资的核心,在动态避险的基础上,追求选股收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	本基金采取恒定比例组合保险策略CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance),通过动态调整资产组合,在确保本金安全的前提下,力争实现保本周期内基金资产的稳定增值。
投资策略	根据恒定比例组合保险原理,本基金将根据市场的波动,组合安全垫(即基金净资产超过基金价值底线的数额)的大小动态调整保本资产与风险资产投资的比例,通过对保本资产的投资实现保本周期到期时投资本金的安全,通过对收益资产的投资寻求保本周期间资产的稳定增值。
业绩比较基准	两年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华富基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	满志弘	郭明
	联系电话	021-68388996	(010)66106798
	电子邮箱	manzh@hfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95588
传真		021-68387997	(010)66105799
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1000号31层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1000号31层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		章宏韬	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年1月30日(基金合同生效日)至2018年6月30日
本期已实现收益	-680,105.73
本期利润	-892,808.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0124
本期加权平均净值利润率	-1.19%
本期基金份额净值增长率	-1.48%
3.1.2 期末数据和指标	2018年6月30日
期末可供分配利润	1,372,003.92
期末可供分配基金份额利润	0.0260
期末基金资产净值	54,327,202.37
期末基金份额净值	1.0286
3.1.3 累计期末指标	2018年6月30日
基金份额累计净值增长率	2.86%

注:1.本基金合同生效未满一年。
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.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。
4.所列数据截止到2018年6月30日。华富安享保本混合证券投资基金从2018年1月30日起转型为华富安享债券证券投资基金。

转型前

金额单位:人民币元

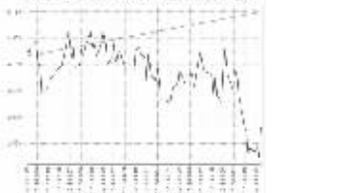
3.1.1 期间数据和指标	2018年1月1日至2018年1月29日
本期已实现收益	1,020,988.19
本期利润	1,524,281.21
加权平均基金份额本期利润	0.0023
本期加权平均净值利润率	0.22%
本期基金份额净值增长率	0.29%
3.1.2 期末数据和指标	2018年1月29日
期末可供分配利润	5,059,058.95
期末可供分配基金份额利润	0.0387
期末基金资产净值	136,279,876.43
期末基金份额净值	1.044
3.1.3 累计期末指标	2018年1月29日
基金份额累计净值增长率	4.40%

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.所列数据截止到2018年1月29日。华富安享保本混合证券投资基金从2018年1月30日起转型为华富安享债券证券投资基金。

3.2 基金净值表现(转型后)
3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.93%	0.31%	0.16%	0.01%	-1.09%	0.30%
过去三个月	-1.45%	0.25%	0.50%	0.01%	-1.95%	0.24%
转型后至今	-1.48%	0.24%	0.86%	0.01%	-2.34%	0.23%

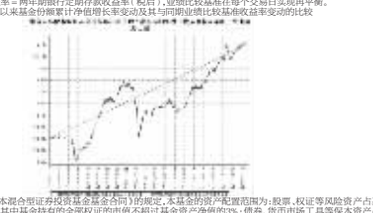
注:业绩比较基准收益率=中证全债指数收益率,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金转型前为华富安享保本混合型证券投资基金,根据《华富安享债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:债券资产的比例不低于基金资产的80%,股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的20%,其中,本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;投资于股金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括内算备付金,存出保证金及应收申购款等。本基金合同生效未满一年,本基金建仓期为2018年1月30日到2018年7月30日。本报告期内,本基金仍在建仓期。
3.2 基金净值表现(转型前)
3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.29%	0.03%	0.17%	0.00%	0.12%	0.03%
过去三个月	0.68%	0.08%	0.52%	0.00%	0.16%	0.08%
过去六个月	2.05%	0.08%	1.03%	0.01%	1.02%	0.07%
过去一年	3.06%	0.07%	2.07%	0.01%	0.99%	0.06%
自基金合同生效起至今	4.40%	0.08%	4.26%	0.01%	0.14%	0.07%

注:业绩比较基准收益率=两年期银行定期存款收益率(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《华富安享保本混合型证券投资基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为2016年1月21日到2016年7月21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《华富安享保本混合型证券投资基金基金合同》的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
基金管理人华富基金管理有限公司于2004年3月29日经中国证监会证监基字[2004]47号文核准开业,4月19日在上海正式注册成立,注册资本2.5亿元,公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和办肥兴泰金融控股(集团)有限公司。截止2018年6月30日,本基金管理人管理了:华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富配置增强混合型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券基金、华富价值增长灵活配置混合型证券基金、华富中证100指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富保本混合型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富恒源10个月定期开放债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永泰丰收灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文筑灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富精英世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富保本保本混合型证券投资基金、华富量子灵活配置混合型证券投资基金、华富成长趋势灵活配置混合型证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富配置增强混合型证券投资基金、华富中证100指数证券投资基金、华富恒源10个月定期开放债券型证券投资基金、华富恒财分级债券型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永泰丰收灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文筑灵活配置混合