

融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

下行。另一方面,一季度社融的收缩,二季度商业银行被管控以及低通胀主体维持持续困难问题也对债市形成压制。展望后续行情,我们认为经济基本面对于债市的安全性仍在,下半年依然存在结构性行情,未来利率水平仍将维持较长一段时间才能真正迎来经济回暖。

债券策略上,组合采取利率债加中高等级信用债配置策略。组合将通过杠杆久期调整,严格的信用把控,在获取收益的前提下,博取超额的资本利得收益。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至本报告期末本基金份额净值为1.115元;本报告期基金份额净值增长率为0.50%,业绩比较基准收益率为-0.14%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

§ 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	156,589,942.63	13.36
其中:股票		156,589,942.63	13.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	847,101,809.70	72.71
其中:债券		847,101,809.70	72.71
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	92,000,567.06	7.90
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	51,343,393.62	4.41
8	其他资产	18,966,402.26	1.62
9	合计	1,166,022,322.04	100.00

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	2,546,060.00	0.22
B	采矿业	363,491.26	0.03
C	制造业	94,589,492.68	8.16
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输业	6,296,302.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	2,611,418.80	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,428,476.06	0.90
J	金融业	14,367,744.04	1.23
K	房地产业	7,127,693.90	0.61
L	租赁和商务服务业	14,034,536.10	1.21
M	科学研究和技术服务业	1,162,204.68	0.10
N	文化、体育和娱乐业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	1,789,976.43	0.15
R	文化、体育和娱乐业	23,100.00	-
S	综合	-	-
合计		156,589,942.63	13.37

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	601088	中国国航	158,314	14,034,536.10	1.21
2	600031	三一重工	533,500	6,978,190.00	0.60
3	000538	维康动力	514,500	6,323,265.00	0.54
4	600891	宇通客车	310,765	6,292,467.00	0.54
5	200830	通海转债	79,426	4,576,485.44	0.39
6	001933	永辉超市	409,000	4,084,000.00	0.36
7	000897	伊路转债	116,600	3,995,600.00	0.33
8	000568	泸州老窖	47,000	3,047,500.00	0.23
9	000585	海螺水泥	92,100	3,022,150.00	0.23
10	002157	正邦科技	215,000	3,066,494.00	0.31

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	130775	16国债02	500,000	49,365,000.00	4.24
2	190201	19国债01	400,000	39,984,000.00	3.44
3	182000	18国债00	300,000	30,942,000.00	2.66
4	101761041	17国债10	300,000	30,435,000.00	2.61
5	101900252	19国债03	300,000	30,246,000.00	2.60

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	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	170209	17国债F06	3,100,000	314,340,000.00	15.46
2	180212	18国债F12	2,500,000	252,000,000.00	12.43
3	180206	18国债F06	1,700,000	169,694,000.00	8.34
4	170205	17国债F05	1,500,000	151,220,000.00	7.44
5	180211	18国债F11	1,000,000	101,200,000.00	4.88

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十名资产支持证券投资明细

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	170209	17国债F06	3,100,000	314,340,000.00	15.46
2	180212	18国债F12	2,500,000	252,000,000.00	12.43
3	180206	18国债F06	1,700,000	169,694,000.00	8.34
4	170205	17国债F05	1,500,000	151,220,000.00	7.44
5	180211	18国债F11	1,000,000	101,200,000.00	4.88

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	170209	17国债F06	3,100,000	314,340,000.00	15.46
2	180212	18国债F12	2,500,000	252,000,000.00	12.43
3	180206	18国债F06	1,700,000	169,694,000.00	8.34
4	170205	17国债F05	1,500,000	151,220,000.00	7.44
5	180211	18国债F11	1,000,000	101,200,000.00	4.88

5.2 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	国债债券	1,687,440,789.19	82.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,687,440,789.19	82.06
其中:政策性金融债		1,687,440,789.19	82.06
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	可转换债券(可交换债)	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,687,440,789.19	82.06

5.1 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	170209	17国债F06	3,100,000	314,340,000.00	15.46
2	180212	18国债F12	2,500,000	252,000,000.00	12.43
3	180206	18国债F06	1,700,000	169,694,000.00	8.34
4	170205	17国债F05	1,500,000	151,220,000.00	7.44
5	180211	18国债F11	1,000,000	101,200,000.00	4.88

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十名资产支持证券投资明细

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	170209	17国债F06	3,100,000	314,340,000.00	15.46
2	180212	18国债F12	2,500,000	252,000,000.00	12.43
3	180206	18国债F06	1,700,000	169,694,000.00	8.34
4	170205	17国债F05	1,500,000	151,220,000.00	7.44
5	180211	18国债F11	1,000,000	101,200,000.00	4.88

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	170209	17国债F06	3,100,000	314,340,000.00	15.46
2	180212	18国债F12	2,500,000	252,000,000.00	12.43
3	180206	18国债F06	1,700,000	169,694,000.00	8.34
4	170205	17国债F05	1,500,000	151,220,000.00	7.44
5	180211	18国债F11	1,000,000	101,200,000.00	4.88

5.2 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	国债债券	1,687,440,789.19	82.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,687,440,789.19	82.06
其中:政策性金融债		1,687,440,789.19	82.06
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	可转换债券(可交换债)	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,687,440,789.19	82.06

5.1 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	170209	17国债F06	3,100,000	314,340,000.00	15.46
2	180212	18国债F12	2,500,000	252,000,000.00	12.43
3	180206	18国债F06	1,700,000	169,694,000.00	8.34
4	170205	17国债F05	1,500,000	151,220,000.00	7.44
5	180211	18国债F11	1,000,000	101,200,000.00	4.88

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十名资产支持证券投资明细

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	169902	16国债02	500,000	15,000,000.00	2.68
2	129926	19国债12A	100,000	10,000,000.00	1.72

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贵金属投资明细

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

本基金本报告期末未持有股票。

本基金本报告期末未持有债券。

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。

本基金本报告期末未持有其他资产。