富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:南京银行股份有限公司
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。基金托管人南京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	富安达行业轮动混合
基金主代码	001660
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年04月04日
报告期末基金份额总额	76,879,599.41份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型,通过对全球经济发展形势、国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测,并据此适时动态检测整个基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型,辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,按照风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	南京银行股份有限公司

§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	10,679,382.04
2.本期利润	-2,188,265.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0245
4.期末基金资产净值	77,465,516.15
5.期末基金份额净值	1.008

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	-4.45%	1.49%	-0.39%	0.90%	-4.06%	0.59%

①本基金业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×中债总指数,

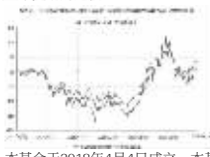
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =60%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+40%×[中债总指数t / 中债总指数(t-1)-1]

Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)

其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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



本基金于2018年4月4日成立,本基金建仓期为本基金合同生效之日起六个月,建仓截止日为2018年10月3日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
毛矛	本基金的基金经理	2018-04-04	-	15年	硕士,历任中华资源(香港)有限公司交易员,海通证券香港有限公司投资分析师,光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2012年4月加入富安达基金管理有限公司任高级行业研究员兼基金经理助理。2015年5月起任富安达策略精选灵活配置混合型基金、富安达健康人生灵活配置混合型基金的基金经理(2015年11月25日至2016年12月17日期间,富安达新动力灵活配置混合型基金、富安达消费主题灵活配置混合型基金、富安达行业轮动灵活配置混合型基金的基金经理。
朱义	本基金的基金经理	2018-11-30	-	16年	硕士,历任金元顺安基金管理有限公司风险管理专员,上投摩根基金管理有限公司高级风险管理经理,富安达基金管理有限公司监察稽核部副总监,研究发展部研究总监助理兼基金经理助理。2018年4月起任富安达长盈灵活配置混合型基金、富安达新动力灵活配置混合型基金、富安达行业轮动灵活配置混合型基金的基金经理。

1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,即基金的首任基金经理,其任职日期为基金合同生效日,其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日;

2、证券从业的含义遵从行业协会关于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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异,未发现公平交易异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年二季度以来市场进入调整阶段,一方面是四月市场担心货币政策边际有所调整;二是五月美国针对华为禁令出台,中美贸易摩擦有进一步升级的趋势。在市场估值回归完成之后,市场风险偏好快速下滑。本基金二季度保持了较高持仓,主要配置在金融、地产、中游制造业等低估值行业以及家电、食品饮料等消费类行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达行业轮动混合基金份额净值为1.008元,本报告期内,基金份额净值增长率为-4.45%,同期业绩比较基准收益率为-0.39%。

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,本基金未发生基金持有人数或资产净值预警的情形。

§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	70,092,552.35	90.17
	其中:股票	70,092,552.35	90.17
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	6,958,301.01	8.95
8	其他资产	686,357.78	0.88
9	合计	77,737,211.14	100.00

由于四舍五入的原因,各比例的分项与合计可能有尾差。

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	459,442.00	-
B	采矿业	255,925.44	-
C	制造业	38,123,380.84	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,843,360.52	-
E	建筑业	2,021,969.56	-
F	批发和零售业	1,462,946.50	-
G	交通运输、仓储和邮政业	154,073.26	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	243,340.80	-
J	金融业	6,195,387.27	-
K	房地产业	18,490,162.94	-
L	租赁和商务服务业	25,040.86	-
M	科学研究和技术服务业	845,734.12	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	71,120,764.11	-

由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通。

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	000651	格力电器	97,672	5,371,960.00	6.93
2	600048	保利地产	395,770	5,050,025.20	6.52
3	000902	新洋丰	320,856	3,442,784.88	4.44
4	000002	万 科A	98,247	2,732,249.07	3.53
5	002146	荣盛发展	275,492	2,586,869.88	3.34
6	600466	蓝光发展	410,583	2,553,826.26	3.30
7	601176	中国巨石	292,684	2,408,078.52	3.11
8	601877	正泰电器	101,867	2,352,109.03	3.04
9	601288	农业银行	580,133	2,088,550.80	2.70
10	601668	中国建筑	345,046	1,984,014.50	2.56

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告末未持有债券。

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

本基金本报告末未持有债券。

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

本基金本报告末未持有贵金属。

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

本基金本报告末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告末未持有股指期货。

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

本基金本报告末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	118,340.85
2	应收证券清算款	531,316.12
3	应收股利	-
4	应收利息	1,618.67
5	应收申购款	795.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	34286.46
8	其他	-
9	合计	686,357.78

由于四舍五入的原因,各比例的分项与合计可能有尾差。

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	137,418,940.97
报告期期间基金总申购份额	1,210,095.84
减:报告期期间基金总赎回份额	61,749,437.40
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	76,879,599.41

§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

本报告期内,基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况,不存在利益冲突、显失公平的关联交易的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内不存在基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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

无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2019年4月10日,富安达基金管理有限公司关于与通联支付合作开通招商银行、农业银行、华夏银行及民生银行借记卡网上直销业务并开展费率优惠活动的公告

2、2019年4月20日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加阳光人寿为代销机构并开通转换业务的公告

3、2019年4月20日,富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金2019年第一季度报告

4、2019年4月24日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告

5、2019年4月26日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加西藏东方财富证券股份有限公司代销机构及参与其费率优惠活动的公告

6、2019年5月11日,富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一九年第一号)正文及摘要

7、2019年5月15日,基金投资者风险承受能力与基金产品风险

8、2019年5月30日,富安达基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告

9、2019年6月5日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券为代销机构并开通转换业务的公告

10、2019年6月21日,富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金司投资科创板股票的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金设立的文件:

《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

3、基金管理人业务资格批件和营业执照;

4、基金托管人业务资格批件和营业执照;

5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所,供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.fadfunds.com)查阅。

富安达基金管理有限公司
2019年07月18日

富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
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。基金托管人上海浦东发展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	富安达长盈混合
基金主代码	002584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年05月11日
报告期末基金份额总额	8,786,213.30份
投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下,通过专业化研究分析,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型,通过对全球经济发展形势、国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测,并据此适时动态检测整个基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型,辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,按照风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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	468,305.20
2.本期利润	-315,019.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0348
4.期末基金资产净值	8,911,345.16
5.期末基金份额净值	1.014

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	-3.52%	1.28%	-0.39%	0.90%	-3.13%	0.38%

①本基金业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×中债总指数,

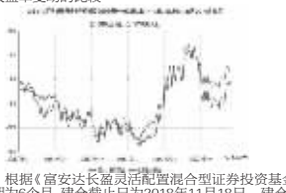
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =60%×[沪深300指数t /沪深300指数(t-1)-1]+40%×[中债总指数t / 中债总指数(t-1)-1]

Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)

其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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



根据《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2018年11月18日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
朱义	本基金的基金经理	2018-04-13	-	16年	硕士,历任金元顺安基金管理有限公司风险管理专员,上投摩根基金管理有限公司高级风险管理经理,富安达基金管理有限公司监察稽核部副总监,研究发展部研究总监助理兼基金经理助理。2018年4月起任富安达长盈灵活配置混合型基金、富安达新动力灵活配置混合型基金、富安达行业轮动灵活配置混合型基金的基金经理。

1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,即基金的首任基金经理,其任职日期为基金合同生效日,其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日;

2、证券从业的含义遵从行业协会关于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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》,并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异,未发现公平交易异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年二季度以来市场进入调整阶段,一方面是四月市场担心货币政策边际有所调整;二是五月美国针对华为禁令出台,中美贸易摩擦有进一步升级的趋势。在市场估值回归完成之后,市场风险偏好快速下滑。本基金保持了较高持仓,主要配置在食品饮料、医药、家电等消费类行业以及金融、地产等低估值行业,参与了电子、通讯等行业投资机会,但因受到中美贸易摩擦的影响,股价有所拖累。随着G20中美贸易重启谈判,科技类个股有望获取较好的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达长盈混合基金份额净值为1.014元,本报告期内,基金份额净值增长率为-3.52%,同期业绩比较基准收益率为-0.39%。

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,本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。针对该情形,本基金管理人的解决方案为:稳健运作,做好基金业绩,稳定基金规模;积极沟通,整合资源,有序推进营销工作。上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。

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	6,570,570.79	71.93
	其中:股票	6,570,570.79	71.93
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	2,495,489.30	27.32
8	其他资产	69,172.31	0.76
9	合计	9,135,232.40	100.00

由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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	112,872.24	1.27
C	制造业	3,360,024.64	37.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	82,026.48	0.92
F	批发和零售业	213,467.04	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	94,093.46	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	982,389.69	11.02
J	金融业	581,095.05	6.52
K	房地产业	432,799.93	4.86
L	租赁和商务服务业	115,245.00	1.29
M	科学研究和技术服务业	216,462.40	2.43
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	188,683.38	2.12
R	文化、体育和娱乐业	191,411.48	2.15
S	综合	-	-
	合计	6,570,570.79	73.73

由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通。

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	000651	格力电器	5,131	282,205.00	3.17
2	002415	海康威视	7,438	205,140.04	2.30
3	600048	保利地产	15,382	196,274.32	2.20
4	600519	贵州茅台	196	192,864.00	2.16
5	601818	光大银行	49,400	188,214.00	2.11
6	000063	中兴通讯	5,761	187,405.33	2.10
7	601988	中国银行	40,200	150,348.00	1.69
8	300253	卫宁健康	10,466	148,407.88	1.67
9	600887	伊利股份	4,349	145,300.09	1.63
10	000002	万 科A	5,162	143,555.22	1.61

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,527.39
2	应收证券清算款	50,581.43
3	应收股利	-
4	应收利息	1,000.34
5	应收申购款	3,063.15
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	69,172.31

由于四舍五入的原因,各比例的分项与合计可能有尾差。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告未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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	9,762,499.92
报告期期间基金总申购份额	29,108.14
减:报告期期间基金总赎回份额	1,005,394.76
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	8,786,213.30

§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

本报告期内,基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况,不存在利益冲突、显失公平的关联交易的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内不存在基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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

无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2019年4月10日,富安达基金管理有限公司关于与通联支付合作开通招商银行、农业银行、华夏银行及民生银行借记卡网上直销业务并开展费率优惠活动的公告

2、2019年4月20日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加阳光人寿为代销机构并开通转换业务的公告

3、2019年4月20日,富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金2019年第一季度报告

4、2019年4月24日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告

5、2019年4月26日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加西藏东方财富证券股份有限公司代销机构及参与其费率优惠活动的公告

6、2019年5月15日,基金投资者风险承受能力与基金产品风险

7、2019年5月30日,富安达基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告

8、2019年6月5日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加长江证券为代销机构并开通转换业务的公告

9、2019年6月21日,富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金司投资科创板股票的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件:

《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

3、基金管理人业务资格批件和营业执照;

4、基金托管人业务资格批件和营业执照;

5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;

6、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所,供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.fadfunds.com)查阅。

富安达基金管理有限公司
2019年07月18日

富安达增强收益债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
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。基金托管人交通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	富安达增强收益债券	
基金主代码	710301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年07月25日	
报告期末基金份额总额	114,020,476.97份	
投资目标	本基金在有控制风险与保持资产流动性的基础上,力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采用自上而下的富安达多维经济模型,运用定性与定量分析方法,通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,判断和预测经济发展周期及趋势,综合比较大类资产的收益及风险情况,确定债券、股票、现金等大类资产配置比例。 在进行固定收益类资产配置时,本基金首先通过久期配置、期限结构配置、类属配置策略来实现对固定收益类资产的配置。本基金的股票类资产作为整体基金投资组合管理的辅助工具,为投资人提供适度参与股票市场、获取超额收益的机会。	
业绩比较基准	中债总指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,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,高于货币市场基金。	
基金管理人	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属分级基金的份额总额	45,125,573.82份	68,894,903.15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04月01日 - 2019年06月30日)	
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
1.本期已实现收益	-2,991,220.15	-4,261,987.09
2.本期利润	-5,538,405.17	-9,047,965.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1059	-0.1009
4.期末基金资产净值	49,454,016.00	73,381,713.39
5.期末基金份额净值	1.0959	1.0651

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

富安达增强收益债券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