

方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

2018年6月30日 基金管理人:方正富邦基金管理有限公司 基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2018年8月29日

重要提示

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其从业人员在基金业务活动中应当遵守法律法规、中国证监会的规定及基金合同、基金招募说明书等法律文件的规定

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预示其未来表现,投资者有风险,投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新

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

本报告中财务资料未经审计

本报告自2018年01月01日起至2018年06月30日止

2 基金简介

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, code, dates, and manager information.

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: Item and Value. Includes investment objectives, strategy, and risk profile.

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item and Value. Lists management and custody details.

2.4 信息披露方式

基金年度报告全文披露日期:2018年12月31日

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和基金净值指标

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial metrics for the period.

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

注:2. 期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

注: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

注:4. 本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正富邦惠利纯债 C

Table with 2 columns: Item and Value. Shows performance metrics for the C class.

注:1. 本基金投资组合资产配置比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%

注:2. 本基金业绩比较基准为:中证综合债指数收益率

注:3. 本基金合同于2016年12月19日生效

注:4. 本基金的建仓期为2016年12月19日至2017年6月18日

注:5. 管理人报告

4.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人方正富邦基金管理有限公司,经中国证监会核准,于2011年7月8日成立

截至2018年6月30日,方正富邦管理8只证券投资基金

方正富邦创新动力混合型证券投资基金,方正富邦红利精选混合型证券投资基金,方正富邦货币市场基金,方正富邦金小宝货币市场证券投资基金,方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金,方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金,方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金,方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金,同时管理11个特定客户资产投资组合

4.2 基金业绩(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with 2 columns: Name and Position. Lists fund managers and their backgrounds.

注:1. "任职日期"和"离任日期"分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期

注:2. 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

方正富邦基金管理有限公司章程的相关规定,经公司投资决策委员会提名,公司决定解除聘任徐德先生方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金基金经理职务,同时向中国证券投资基金业协会递交基金基金经理变更申请

2018年2月23日协会审核通过变更申请,2018年2月28日公司正式解除徐德先生方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金基金经理职务,并于2018年3月1日进行了公开信息披露

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求合法权益

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待了管理的所有投资组合

在投资决策内部控制方面,本基金管理人建立了统一的投资管理决策平台和公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库,确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年上半年,债券市场一直维持今年以来牛市局面,在资金面继续保持宽松、政策面央行三次降准和外围中美贸易战不确定的多重利好下,十年期国债收益率较2017年年底下移超40BP,多利期开,开期收益率下移超73BP,未来债券市场是否能继续保持利率下行态势,仍需密切关注

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值为 1.0190 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.31%,截至本报告期末方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值为 1.0277 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.31%;同期业绩比较基准收益率为 2.16%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 3 季度,投资短期而言向好,进出口在贸易战的阴云下也面临较大压力,消费品的边际效应也较小,经济面临的压力依旧较大,从央行近来的表态看,资金面短期内仍将保持较为宽松的局面,目前来看,预计利率债收益率短期依旧低位徘徊,未来本基金仍将在严控风险的前提下,相机配置资产,为投资者争取稳定收益

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金合同等规定,本基金本报告期内实施利润分配 1 次,方正富邦惠利纯债 A 以 2018 年 3 月 26 日已实现的可供分配收益 6,832,406.52 元为基准计算,2018 年 4 月 2 日向本基金的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.05 元

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,本托管人在对方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金的基金管理人——方正富邦基金管理有限公司在方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各主要方面的运作严格按照基金合同的有关规定进行

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对方正富邦基金管理有限公司编制和披露的方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows balance sheet data for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.2 利润表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows profit and loss data for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

Table with 2 columns: Item and Value. Shows financial data for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 A 基金份额净值 1.0190 元,基金份额总额 808,169,176.85 份

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦惠利纯债 C 基金份额净值 1.0277 元,基金份额总额 5,192,387.33 份

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with 2 columns: Item and Value. Shows equity changes for the period.

单元进行的股票交易

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的债券交易

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的债券回购交易

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的权证交易

6.4.8.1.5 应付关联方佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生应付关联方的佣金

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

注:支付基金管理人方正富邦基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付

6.4.8.2.2 基金托管费

注:支付基金托管人浙商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付

6.4.8.2.3 销售服务费

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给方正富邦基金,再由其支付给各基金销售机构

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

注:本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管,按银行同业利率计息

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末(2018 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.9.3 期末债券正回购及处于逆回购中的债券

6.4.9.4 银行间市场债券正回购

6.4.9.5 其他关联交易事项的说明

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.5 投资组合报告

6.5.1 期末基金资产组合情况

6.5.2 期末按行业分类的股票投资组合

6.5.3 期末按行业分类的债券投资组合

6.5.4 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

6.5.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

6.5.6 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

6.5.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

6.5.8 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

6.5.9 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

6.5.10 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

6.5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

6.5.12 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

6.5.13 投资组合报告附注

6.6 投资组合报告附注

6.6.1 报告期内基金投资的前十名股票

6.6.2 报告期内基金投资的前十名债券

6.6.3 报告期内基金投资的前十名资产支持证券

6.6.4 报告期内基金投资的前十名权证

6.6.5 报告期内基金投资的前十名贵金属

6.6.6 报告期内基金投资的前十名权证

6.6.7 报告期内基金投资的前十名权证

6.6.8 报告期内基金投资的前十名权证

6.