

华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016年第3季度报告

2016年9月30日

基金管理人：华富基金管理有限公司

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：2016年10月25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 2016 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为 2016 年 7 月 1 日至 2016 年 9 月 30 日。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华富诚鑫灵活配置混合	
基金主代码	002726	
交易代码	002726	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 5 月 5 日	
报告期末基金份额总额	667,640,811.61 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，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健增值。	
投资策略	本基金投资策略的基本思想是在充分控制风险的前提下实现高收益。依据风险-收益-投资策略关系原理，本基金采用包括资产配置策略、行业配置策略和个股精选策略在内的多层次复合投资策略进行实际投资，高层策略作用是规避风险，低层策略用于提高收益。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等收益风险特征的基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。	
基金管理人	华富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华富诚鑫灵活配置混合 A	华富诚鑫灵活配置混合 C

下属分级基金的交易代码	002726	002727
报告期末下属分级基金的份额总额	667, 123, 349. 93 份	517, 461. 68 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（ 2016 年 7 月 1 日 — 2016 年 9 月 30 日 ）	
	华富诚鑫灵活配置混合 A	华富诚鑫灵活配置混合 C
1. 本期已实现收益	7, 620, 597. 62	5, 409. 68
2. 本期利润	8, 096, 677. 33	4, 745. 36
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0156	0. 0228
4. 期末基金资产净值	678, 883, 902. 85	540, 984. 43
5. 期末基金份额净值	1. 018	1. 045

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。

3.2 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

华富诚鑫灵活配置混合 A

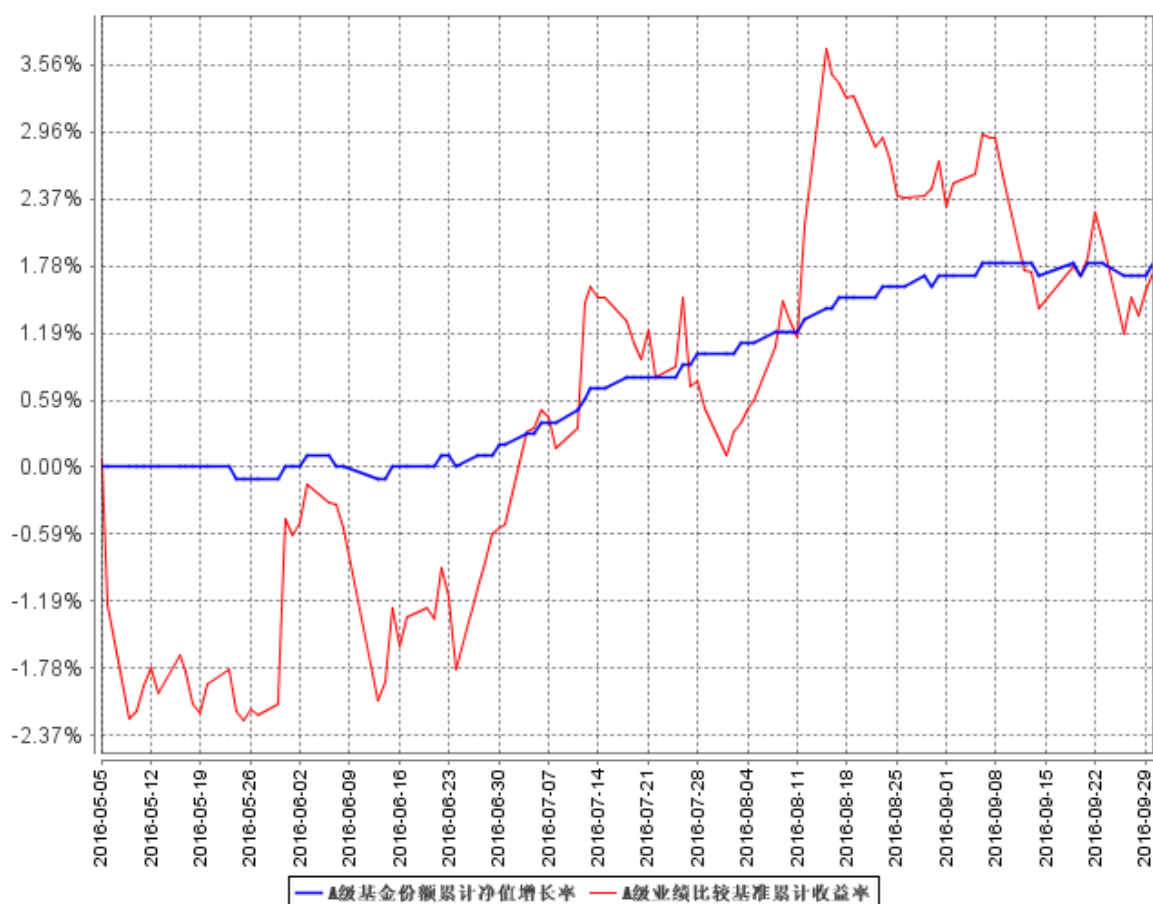
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1. 60%	0. 06%	2. 27%	0. 40%	-0. 67%	-0. 34%

华富诚鑫灵活配置混合 C

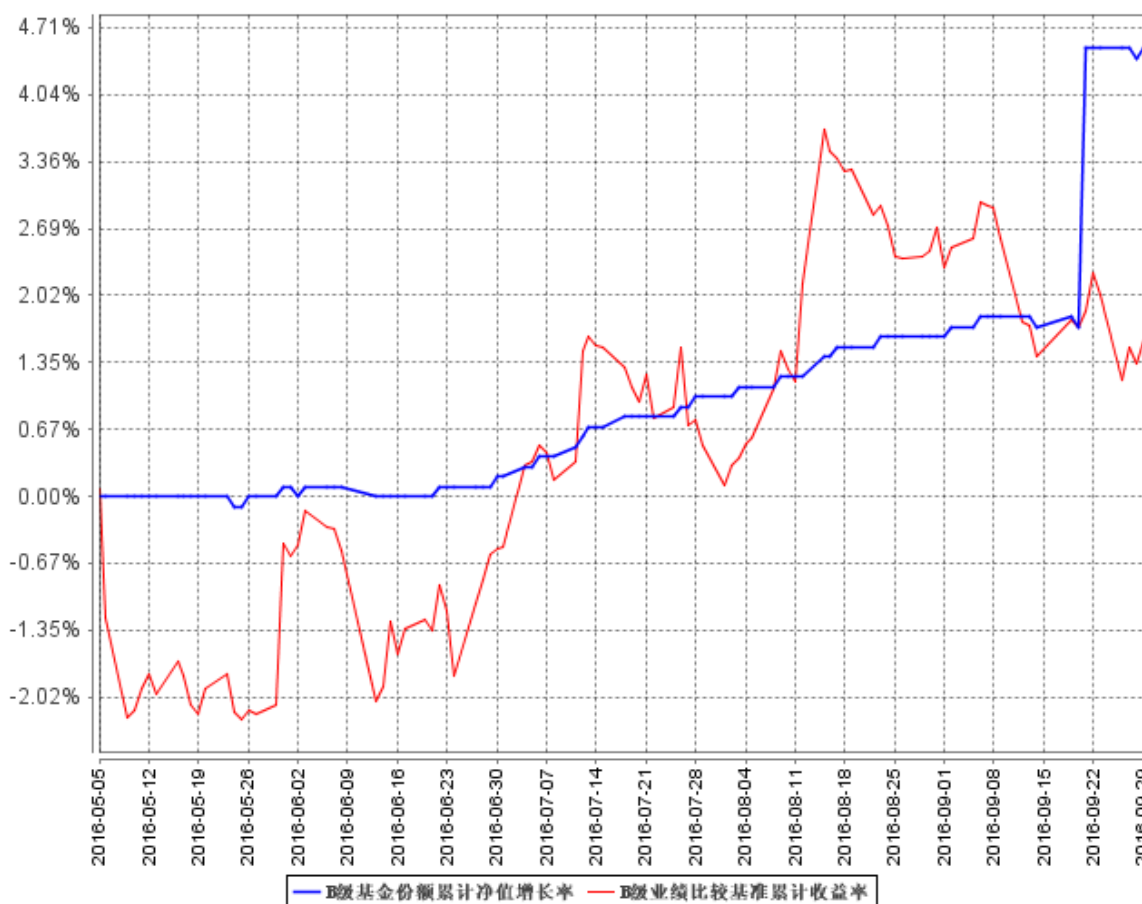
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4. 29%	0. 35%	2. 27%	0. 40%	2. 02%	-0. 05%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



	富货币市场基金基金经理、华富安享保本混合型基金基金经理、固定收益部总监助理			新华财经有限公司信用评级部高级分析师、上海新世纪资信评估投资服务有限公司高级分析师、德邦证券有限责任公司固定收益部高级经理，2012 年加入华富基金管理有限公司，曾任固定收益部信用研究员。
--	---------------------------------------	--	--	--

注：这里的任职日期指该基金成立之日。证券从业年限的计算标准上，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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规，对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规，未发现异常情况；相关信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度整体经济表现仍然较为疲弱，工业增长乏力，投资增速下滑，经济下行压力仍大，通胀持续回落，基本面对债市依然有支撑。广义融资收缩，理财利率下行，社会投资预期回报率持续下降，广义基金资产配置压力持续加大。央行重启 14 天逆回购，释放对市场过度运用短期资金放杠杆行为的担忧，对市场形成阶段性冲击。但三季度债券市场仍然维持收益率下行的趋势，收

益率曲线继续平坦化。三季度权益市场震荡盘升，主要机会仍集中各类主题性投资及消费类蓝筹。本基金以债券、新股申购等低风险资产投资为主，三季度净值继续稳步上涨。

基本面的支撑、广义基金的配置压力仍是促使债券市场收益率曲线继续平坦化动力来源。基本面的支撑、供给侧改革和 L 型经济走势仍对债市中长期走势有较强支撑，对违约造成系统性风险的担忧在下降，债券收益率整体下行趋势仍未改变。十一期间全国主要城市均出台限制房地产过快上涨的政策，短期进一步强化了后期房地产销量下滑、投资增速下降、房贷回落的预期，信用收缩有利于长端利率债的下行。但目前短端利率始终维持不变，期限利差和信用利差依然处于低位，通胀预期有所反复，人民币贬值压力仍大，而市场对全球央行货币持续宽松的预期在发生转变，美、日、德等国家的长期国债收益率均有所反弹，或对长端利率下行幅度形成制约。权益市场整体机会不大，短期或仍偏向防御。本基金将严控债券信用风险和久期风险，获取稳定回报，权益仓位严格控制大幅波动和回撤，并利用新股申购增强收益，稳健地做好配置策略，均衡投资，力争为基金持有人获取合理的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于 2016 年 5 月 5 日正式成立。截止到 2016 年 9 月 30 日，华富诚鑫 A 类基金份额净值为 1.018 元，累计份额净值为 1.018 元，本报告期的份额累计净值增长率为 1.60%，同期业绩比较基准收益率为 2.27%；华富诚鑫 C 基金份额净值为 1.045 元，累计份额净值为 1.045 元，本报告期的份额累计净值增长率为 4.29%，同期业绩比较基准收益率为 2.27%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

从 2016 年 6 月 7 日起至本报告期末（2016 年 9 月 30 日），本基金基金资产净值存在连续六十个工作日不满二百人的情形，至本报告期期末（2016 年 9 月 30 日）本基金持有人数仍不满二百人。本基金管理人会根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取相关措施，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§ 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	33,001,740.11	3.88
	其中：股票	33,001,740.11	3.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	777,409,590.00	91.45
	其中：债券	777,409,590.00	91.45

	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	7,467,503.73	0.88
8	其他资产	32,170,206.96	3.78
9	合计	850,049,040.80	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	3,402,000.00	0.50
C	制造业	10,298,484.11	1.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,767,500.00	0.85
E	建筑业	24,510.48	0.00
F	批发和零售业	2,005,547.63	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	3,613,980.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	7,889,717.89	1.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	33,001,740.11	4.86

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无

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	601939	建设银行	730,000	3,781,400.00	0.56
2	600009	上海机场	134,000	3,613,980.00	0.53
3	600028	中国石化	700,000	3,402,000.00	0.50
4	600332	白云山	120,000	2,932,800.00	0.43
5	600276	恒瑞医药	58,000	2,554,900.00	0.38
6	600525	长园集团	179,967	2,501,541.30	0.37
7	600900	长江电力	180,000	2,394,000.00	0.35
8	002701	奥瑞金	220,000	2,204,400.00	0.32
9	601139	深圳燃气	230,000	2,159,700.00	0.32
10	601998	中信银行	350,000	2,093,000.00	0.31

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	40,040,000.00	5.89
	其中：政策性金融债	40,040,000.00	5.89
4	企业债券	215,695,590.00	31.75
5	企业短期融资券	521,674,000.00	76.78
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	777,409,590.00	114.42

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	011699926	16 巨石 SCP001	500,000	50,185,000.00	7.39
2	0980154	09 福州交通债	400,000	40,552,000.00	5.97
3	011699072	16 天士力药 SCP001	400,000	40,164,000.00	5.91
4	122780	PR 长高新	474,900	34,216,545.00	5.04

5	041662032	16 威高 CP001	300,000	30,189,000.00	4.44
---	-----------	----------------	---------	---------------	------

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

注：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

注：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

注：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

注：本报告期末本基金无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定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	67,764.22
2	应收证券清算款	19,965,066.66
3	应收股利	-
4	应收利息	12,119,376.08
5	应收申购款	3,000.00
6	其他应收款	15,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,170,206.96

注：其他应收款为应收分销手续费返还

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600525	长园集团	2,501,541.30	0.37	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告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

项目	华富诚鑫灵活配置混合 A	华富诚鑫灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	500,004,949.04	187,966.11
报告期期间基金总申购份额	167,121,879.88	970,595.50
减：报告期期间基金总赎回份额	3,478.99	641,099.93
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	667,123,349.93	517,461.68

§ 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

注：本报告期内本基金管理人没有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交易明细

注：本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富诚鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

8.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。