

# 富安达聚优 2 号 FOF 集合资产管理计划

## 2022 年四季度报告

资产管理人：富安达基金管理有限公司

资产托管人：广发银行股份有限公司



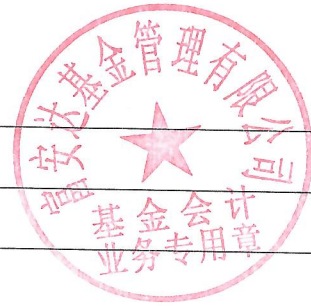
## 一、重要提示

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。基金托管人广发银行股份有限公司根据本计划合同规定，已复核了本报告中的相关内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺诚实信用、勤勉尽责，但不保证计划一定盈利。

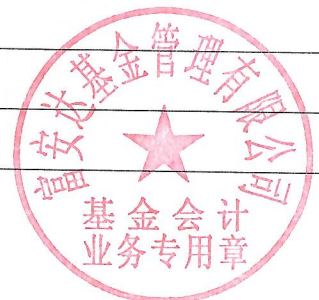
## 二、产品基本情况

表-1：产品基本情况

产品简称	富安达聚优2号 FOF
合同生效日	2022年7月20日
产品存续期	10年
初始基金资产（元）	11,800,000.00
报告期末基金资产净值（元）	5,657,491.21
投资目标	追求在严格控制风险的前提下，委托财产在委托期限内的稳健增值。
投资策略	<p>1、资产管理产品投资策略</p> <p>通过管理人对宏观经济和金融市场的分析判断制定资产配置方案，建立产品库作为投资的依据。</p> <p>本集合计划管理人根据宏观经济情况确定资产配置方向，选择相应策略和风格的资产管理产品管理人。同时利用市场波动，动态调整不同产品间的配置结构，进一步提升产品收益。通过对投资对象的风险收益特征分析以及投资特性分析，选择符合条件的资产管理产品进行投资，并定期进行业绩跟踪和分析，适时作出相应的投资调整。</p> <p>2、现金类管理工具投资策略</p> <p>本集合计划将投资于银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金等高流动性资产来保障资产的流动性。</p>
管理费的计提基准、计提方式和支付方式	<p>(1) 固定费率管理费:按前一日计划财产净值的1.00%年费率计提，每日计提，每半年支付一次。</p> <p>(2) 资产管理人的业绩报酬</p> <p>以投资者的参与日（初始募集期参与的为资产管理计划成立日，存续期参与的为参与日）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。其中业绩报酬计提日即为资产管理计划投资者退出日和资产管理计</p>



	<p>划终止日。年化收益率计算方法为：</p> $R = \frac{S_T^* - S_0^*}{S_0} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p>R：指投资者的参与日至本次业绩报酬计提日的年化收益率；  S*T：指本次业绩报酬计提日的累计单位净值；  S*0：指投资者的参与日的累计单位净值；  S0：指投资者的参与日的单位净值（即投资者参与资产管理计划的参与价格）；  T：指投资者的参与日至本次业绩报酬计提日的自然天数。</p> <p>管理人按如下标准和方法提取业绩报酬：  ①当 R≤6.00%时，管理人不收取业绩报酬；  ②业绩报酬=S<sub>i</sub>×S<sub>0</sub> × (R-B) × T/365 × 20%  其中：  S<sub>i</sub> 为资产委托人每笔退出份额或计划终止所持有的份额；  T 为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额自《资产管理合同》成立日或参与确认日起始的持有天数（适用于未收取过业绩报酬的份额）或上一次业绩报酬计算收取日后起始的持有天数（适用于收取过业绩报酬的份额，若上次业绩报酬计算收取日该笔份额实际未超过业绩报酬计提基准，则该笔份额的 T 的计算仍视为未收取过业绩报酬计算）  B 为资产管理计划业绩报酬计提基准 6%。</p>
托管费的计提基准、计提方式和支付方式	按前一日计划财产净值的 0.05%年费率计提，每日计提，每半年支付一次。
业绩比较基准	无
资产管理人	富安达基金管理有限公司
资产托管人	广发银行股份有限公司



### 三、管理人履职报告

#### 3.1 管理人及投资经理情况

##### 3.1.1 管理人及其管理产品的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。



截至 2022 年 12 月 31 日，公司共管理 14 只专户产品：富安达—巨杉鸿 6 号混合型集合资产管理计划、富安达—巨杉鸿 7 号混合型集合资产管理计划、富安达—富享 21 号权益类单一资产管理计划、富安达—富享 23 号固定收益类集合资产管理计划、富安达—富享 38 号权益类单一资产管理计划、富安达安盈 1 号混合类集合资产管理计划、富安达睿选 1 号单一资产管理计划、富安达祥瑞 1 号混合类集合资产管理计划、富安达睿选 5 号权益类单一资产管理计划、富安达聚优 2 号 FOF 集合资产管理计划、富安达祥瑞 2 号混合类单一资产管理计划、富安达睿选 4 号权益类单一资产管理计划、富安达基金承恒单一资产管理计划、富安达聚优 2 号 FOF 集合资产管理计划。

### 3.1.1 投资经理简介

孙辰昶, 英国杜伦大学金融学专业硕士研究生。8 年证券从业年限。2014 年加入富安达基金管理有限公司任交易员、债券研究员、基金经理助理，现任投资经理兼债券研究员。

## 3.2 管理人对报告期内本产品运作合规守信情况的说明

本产品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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其各项实施准则、《富安达聚优 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》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产品资产,在严格控制风险的基础上,为谋求资产委托人最大利益,无损害资产委托人利益的行为。本产品无违法、违规行为。本产品投资组合符合有关法规及产品合同的约定。

## 3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 3.3.1 公平交易制度的执行情况

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》。

### 3.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本产品存在异常交易行为。

### 3.4.报告期内产品的业绩表现

截至报告期末，富安达聚优2号 FOF 集合资产管理计划产品单位净值为 0.9754 元，本报告期内，产品净值增长率为 -2.1469 %。

### 3.5. 报告期内管理人对产品资产净值预警情形的说明

无

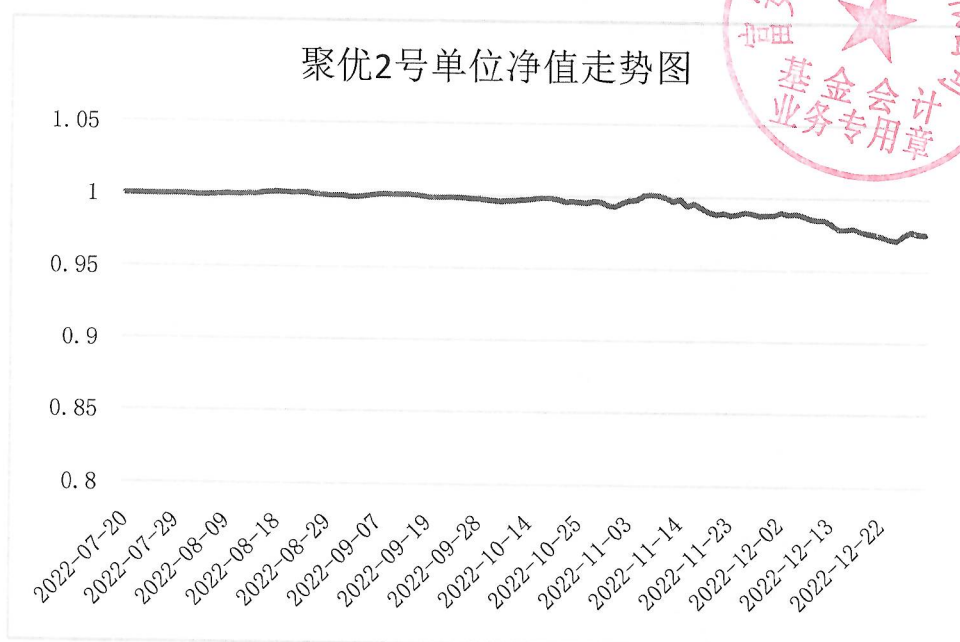
## 四、托管人履职报告

2022 年四季度，产品托管人在富安达聚优 2 号 FOF 集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、产品合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害资产委托人利益的行为。

## 五、产品净值表现

富安达聚优 2 号 FOF 集合资产管理计划成立于 2022 年 7 月 20 日，截至 2022 年 12 月 31 日，本产品业绩表现如下：

图-1：聚优 2 号 FOF 净值走势图



数据来源：富安达聚优 2 号 FOF 净值波动表

表-2：财务指标数据

年初单位净值：	1.000
报告期末单位净值：	0.9754

净值年增长率(%):	-2.4600
本年已实现收益:	14,069.59
从成立日开始的累计已实现收益:	14,069.59
可分配利润:	-142,538.79
单位可分配利润:	-0.025

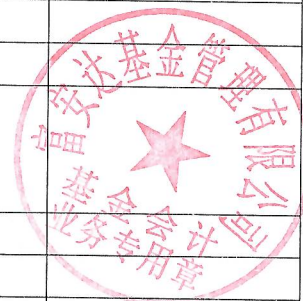
数据来源: 富安达聚优2号FOF估值表(2022年12月31日)

## 六、产品投资组合报告

表-3: 投资组合情况

序号	资产类别	市值(元)	占净值的比例(%)
1	股票		
2	基金	5,600,943.90	99.0005
3	债券		
4	其中: 央票		
5	国债		
6	政策性金融债		
7	金融债(商业银行次级债、商业银行普通债券、证券公司短期融资券、其他金融债券)		
8	企业债		
9	企业短期融资券		
10	可转债		
11	权证		
12	资产支持证券		
13	货币市场工具(票据、CD)		
14	现金(银行存款及清算备付金)	98,702.58	1.7446
15	银行定期存款(定期存款、通知存款、大额存单)		
16	其他资产(交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等)		
17	其中: 买入返售证券		
18	私募理财产品		
19	资产合计	5,699,646.48	100.7451

数据来源: 富安达聚优2号FOF估值表(2022年12月31日)





## 七、资产管理计划投资收益分配情况

无

## 八、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

报告期内，富安达聚优 2 号 FOF 集合资产管理计划的投资经理由唐遥衍、孙辰昶变更为孙辰昶。已根据合同要求进行相关信息披露。



## 九、本产品报告期内投资运作及风险管控情况

固收方面，四季度债市利率先下后上。10 月，资金面维持宽松，美债利率大幅上行后回落、人民币汇率承压，经济延续弱修复走势，长短端利率月中窄幅震荡后转为下行。11 月初至 12 月上旬，防疫政策优化和地产支持政策密集出台，市场开始交易“强预期”，债市大幅回调。债市的快速调整导致理财破净比例大面积上升，发生了“净值下跌—投资者赎回—银行理财/基金减仓—债券抛售—净值下跌—再赎回”的负反馈，信用利差快速走阔，二永债遭到抛售，曲线熊平。12 月 6 日，10 年期国债利率触及年内高点 2.92%。12 月中下旬，理财赎回负反馈情绪逐渐缓和，央行加大投放力度呵护年末流动性，债市止跌回暖，但信用债利率水平和利差分位数相对于大跌前仍处于偏高位置。

权益方面，四季度 A 股以震荡为主：10 月初至今，地产纾困政策频出，防疫政策优化，权益反。但转债市场受债市负反馈影响，表现相对低迷。A 股方面，目前市场正逐步过渡到疫后经济修复逻辑，短期经济离疫后修复的拐点渐进。可转债方面，债市调整压力下转债估值呈现压缩趋势。

报告期内，本产品的仓位和品种基本保持了稳定，在市场调整过程中不断优化结构。截止 2022 年四季度末，本产品净值为 0.9754 元，持仓基金 17 只，其中短债基金 1 只，中长债基金 7 只，一级债基 3 只，二级债基 2 只，偏债混合基金 1 只，灵活配置基金 3 只，后续将根据大类资产走势动态调整组合持仓。

## 十、其他情况

（一）本报告期末，本产品未持有私募资管产品，持有公募基金按照其法律文件收取管理费、托管费、认/申购费、赎回费、销售服务费等费用。

（二）募集期间，资产管理人子公司运用自有资金认购本计划 2,000,000.00 元。

报告期内，资产管理人子公司自有资金在开放期内赎回本计划份额 1,500,000.00 份。资产管理人及相关关联方投资本计划情况如下：资产管理人子公司自有资金持有本计划份额 500,000.00 份。

本计划已按要求对相关情况进行披露，并按规定对资产管理计划账户进行监控，账户无异常。

富安达基金管理有限公司  
二〇二三年一月三十一日





# 富安达聚优2号FOF集合资产管理计划 2022年四季度托管报告

(2022年10月01日—2022年12月31日)

## 一、报告期内本计划托管人合规守信情况声明

本报告期内，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守有关法律法规及合同协议的规定，不存在损害本基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

## 二、托管人对报告期内投资运作情况的说明

本报告期内，本托管人根据有关法律法规及合同协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对费用开支、收益分配等进行了认真的复核，未发现本基金管理人有任何违反法律法规、合同协议及损害基金份额持有人利益的行为。

## 三、托管人对报告期内的财务信息发表意见

本报告期内，本托管人认真复核了管理人提供的财务数据、信息披露报告等材料，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

广发银行股份有限公司深圳分行托管业务部

2023年1月13日

