

富安达科技创新混合型发起式证券投资基金

2023年第3季度报告

2023年09月30日

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:2023年10月24日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	9
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	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	10
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	10
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	10
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	10
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	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§6 开放式基金份额变动	11
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况	12
§9 影响投资者决策的其他重要信息	12
9.1 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	13
9.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§10 备查文件目录	14
10.1 备查文件目录	14
10.2 存放地点	15
10.3 查阅方式	15

§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2023年10月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达科技创新混合
基金主代码	009789
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年09月18日
报告期末基金份额总额	115,271,767.27份
投资目标	本基金重点关注以科技为创新驱动力、具有良好的创新管理和文化，在产业竞争中具有优势和持续发展能力的优质企业。在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，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，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、衍生品、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。一般情况下，本基金将大部分基金资产投资于科技创新主题相关的上市公司股票，当证券市场系统性风险加大时，本基金将对相关证券资产的配置比例做出适时调整。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成分指数收益率*75%+上证国债

	指数收益率*25%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富安达科技创新混合A	富安达科技创新混合C
下属分级基金的交易代码	009789	019253
报告期末下属分级基金的份额总额	49,651,788.67份	65,619,978.60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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	富安达科技创新混合A	富安达科技创新混合C
1.本期已实现收益	-5,271,771.74	66,100.23
2.本期利润	-7,568,777.91	-102,959.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1756	-0.0020
4.期末基金资产净值	50,805,148.19	67,139,627.16
5.期末基金份额净值	1.02322896	1.02315832

注：

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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

富安达科技创新混合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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-15.33%	1.31%	-8.36%	0.84%	-6.97%	0.47%
过去六个月	-18.19%	1.10%	-14.65%	0.87%	-3.54%	0.23%
过去一年	-13.01%	1.06%	-14.72%	0.94%	1.71%	0.12%
过去三年	2.45%	1.32%	-23.68%	1.17%	26.13%	0.15%
自基金合同生效起至今	2.32%	1.32%	-23.10%	1.17%	25.42%	0.15%

富安达科技创新混合C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
自基金合同生效起至今	0.35%	0.91%	-1.65%	0.85%	2.00%	0.06%

注：本基金自 2023 年 8 月 28 日起新增 C 类份额。

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

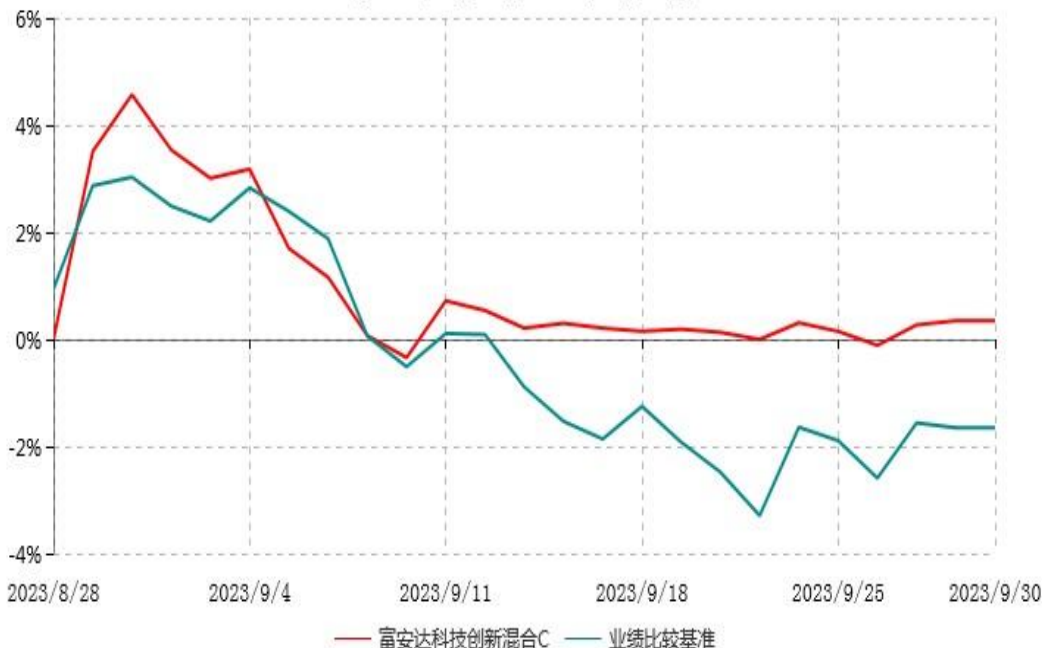
富安达科技创新混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年09月18日-2023年09月30日)



富安达科技创新混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023年08月28日-2023年09月30日)



注：本基金自 2023 年 8 月 28 日起新增 C 类份额。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨红	本基金的基金经理	2023-06-08	-	12年	硕士。历任齐鲁证券研究所分析师；第一创业证券股份有限公司资管部分析师；东海基金投资部研究部负责人、权益投资部副总监、基金经理。2022年加入富安达基金管理有限公司任监察稽核部风控经理。现任权益投资部基金经理，2023年4月起任富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达产业优选

					混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：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证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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、《富安达科技创新混合型发起式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，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度上证指数跌2.8%，创业板指跌9.5%，期间涨幅较大的是煤炭（中信，下同）涨10.37%，非银金融涨6.48%，石油石化涨5.79%，跌幅后三位是传媒跌14.19%，计算

机跌13.88%，电力设备及新能源跌13.52%。各行业间的涨跌幅分化较大，三季度陆续出台了各种稳增长的政策，相比二季度，三季度市场各项经济数据逐渐企稳，目前看，未来随着稳经济、促发展的各项政策陆续出台，预计经济将呈现逐步修复的态势。

本季度我们重点配置了人工智能、智能汽车、医药、石油等相关板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达科技创新混合A基金份额净值为1.02322896元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.33%，同期业绩比较基准收益率为-8.36%；截至报告期末富安达科技创新混合C基金份额净值为1.02315832元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.35%，同期业绩比较基准收益率为-1.65%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	92,540,957.79	77.38
	其中：股票	92,540,957.79	77.38
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	20,008,571.17	16.73
	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	7,037,186.71	5.88
8	其他资产	4,366.04	0.00
9	合计	119,591,081.71	100.00

注：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	-	-
B	采矿业	10,370,406.00	8.79
C	制造业	61,886,109.79	52.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,079,385.00	11.09
J	金融业	-	-
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	3,576,470.00	3.03
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	3,628,587.00	3.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	92,540,957.79	78.46

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项与合计可能有尾差。

5.2.2 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投资的股票。

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	601138	工业富联	276,500	5,447,050.00	4.62
2	688581	安杰思	42,165	4,891,140.00	4.15
3	603985	恒润股份	173,600	4,744,488.00	4.02
4	688266	泽璟制药	88,705	4,136,314.15	3.51
5	600602	云赛智联	258,800	3,856,120.00	3.27
6	300308	中际旭创	32,100	3,717,180.00	3.15
7	301239	普瑞眼科	30,900	3,628,587.00	3.08
8	603259	药明康德	41,500	3,576,470.00	3.03
9	300601	康泰生物	121,400	3,553,378.00	3.01
10	600938	中国海油	166,100	3,511,354.00	2.98

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

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

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

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股票库。**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,366.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,366.04

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

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

	富安达科技创新混合A	富安达科技创新混合C
报告期期初基金份额总额	40,831,829.92	-
报告期期间基金总申购份额	13,491,674.60	171,775,882.21
减：报告期期间基金总赎回份额	4,671,715.85	106,155,903.61
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	49,651,788.67	65,619,978.60

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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**

单位：份

	富安达科技创新混合 A	富安达科技创新混合 C

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	20.14	0.00

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,000.00	8.67%	9,999,000.00	8.67%	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	9,999,000.00	8.67%	9,999,000.00	8.67%	自合同生效之日起不少于3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230701-20230907	9,999,000.00	0.00	0.00	9,999,000.00	8.67%
	2	20230701-20230912	11,999,000.00	0.00	0.00	11,999,000.00	10.41%
	3	20230925-20230930	0.00	35,137,515.90	0.00	35,137,515.90	30.48%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

注：

- ①"申购份额"包含份额申购、转换转入、红利再投等导致份额增加的情况；
- ②"赎回份额"包含份额赎回、转换转出等导致份额减少的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.2023年7月19日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金新增开源证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告

2.2023年7月20日，富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告

3.2023年7月20日，富安达科技创新混合型发起式证券投资基金2023年第2季度报告

4.2023年7月27日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告

5.2023年7月28日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司（同业易管家平台）为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务的公告

6.2023年8月5日，富安达基金管理有限公司关于董事长变更的公告

7.2023年8月5日，富安达基金管理有限公司关于董事变更情况的公告

8.2023年8月11日，富安达基金管理有限公司关于富安达科技创新混合型发起式证券投资基金证券交易模式转换并修订基金托管协议的公告

9.2023年8月11日，富安达科技创新混合型发起式证券投资基金托管协议

10.2023年8月16日，富安达基金管理有限公司关于富安达科技创新混合型发起式证券投资基金证券交易模式转换完成的公告

11.2023年8月16日，富安达科技创新混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二三年第四号）

12.2023年8月16日，富安达科技创新混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新

13.2023年8月18日，富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告

14.2023年8月19日,富安达基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等事项的公告

15.2023年8月19日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(二〇二三年第五号)

16.2023年8月19日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金基金合同

17.2023年8月19日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金托管协议

18.2023年8月19日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新

19.2023年8月28日,富安达基金管理有限公司关于富安达科技创新混合型发起式证券投资基金增设C类基金份额并修订基金合同和托管协议的公告

20.2023年8月28日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金基金合同

21.2023年8月28日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金托管协议

22.2023年8月28日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(二〇二三年第六号)

23.2023年8月28日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新

24.2023年8月29日,富安达基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告

25.2023年8月29日,富安达科技创新混合型发起式证券投资基金2023年中期报告

26.2023年8月31日,富安达基金管理有限公司关于富安达科技创新混合型发起式证券投资基金C类份额新增开源证券股份有限公司为销售机构的公告

27.2023年9月1日,富安达基金管理有限公司关于富安达科技创新混合型发起式证券投资基金C类份额新增国泰君安证券股份有限公司为销售机构的公告

28.2023年9月4日,富安达基金管理有限公司关于富安达科技创新混合型发起式证券投资基金C类份额新增南京证券股份有限公司为销售机构的公告

29.2023年9月11日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告

30.2023年9月14日,富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告

31.2023年9月23日,富安达基金管理有限公司关于提高富安达科技创新混合型发起式证券投资基金份额净值精度的公告

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会准予富安达科技创新混合型发起式证券投资基金注册的文件:

《富安达科技创新混合型发起式证券投资基金招募说明书》;

《富安达科技创新混合型发起式证券投资基金基金合同》;

《富安达科技创新混合型发起式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。

10.2 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。

10.3 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

2023年10月24日