



Your complimentary  
use period has ended.  
Thank you for using  
PDF Complete.

富安人生灵活配置混合型证券投资基金2016年第3季度报告

---

[Click Here to upgrade to  
Unlimited Pages and Expanded Features](#)

## 富安达健康人生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：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：2016年10月24日

## 重要提示及目录

### 1.1 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2016年10月21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2016年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富安达健康人生混合
基金主代码	001861
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月25日
报告期末基金份额总额	222,785,004.18份
投资目标	本基金通过资产的灵活配置，重点投资于能够满足人们对优质健康生活需求的上市公司，在有效控制风险的前提下，力争为投资者带来长期稳定的超额收益。
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、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健康人生主题下的上市公司证券，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。

300 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%

风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
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

### § 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）
1. 本期已实现收益	11,209,476.82
2. 本期利润	2,554,370.22
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0109
4. 期末基金资产净值	223,469,658.10
5. 期末基金份额净值	1.0031

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	0.61%	0.79%	2.71%	0.49%	-2.10%	0.30%

注：注：①本基金业绩比较基准为：60%×沪深300指数+40%×中债总财富总指数，

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：

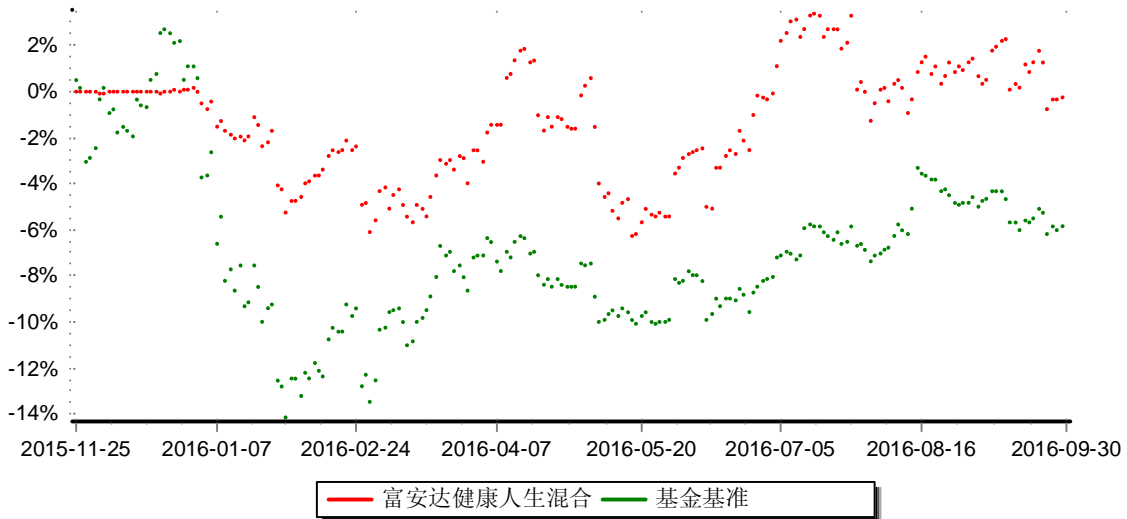
$Return_t = 60\% \times [沪深300指数_t / 沪深300指数_{(t-1)} - 1] + 40\% \times [中债总财富总指数_t / 中债总财富总指数_{(t-1)} - 1]$

mark(t-1)

至日。

Click Here to upgrade to Unlimited Pages and Expanded Features

### 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



注：本基金于2015年11月25日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。根据《富安达健康人生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2016年5月24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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
毛矛	本基金的基金经理，富安达策略精选灵活配置混合型证券	2015年11月25日	—	12年	历任中华资源贸易有限公司交易员；易唯思商务咨询有限公司分析师；光大保德信基金管理有限公司研究员。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	经理, 公司研究发展部高级行业研究员兼基金经理				
李守峰	本基金的基金经理, 公司研究发展部行业研究员兼基金经理	2015年12月25日	—	6年	历任万联证券研究所医药研究员。博士研究生, 具有基金从业资格。中国国籍。

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、《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金合同》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

组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易，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

三季度A股分化较为明显，大市值股票表现明显强于中小市值股票，以总市值加权平均法计算二季度上证A股上涨了4.31%，深证A股上涨0.91%，中小板下跌0.33%，创业板下跌4.08%。从细分行业看，三季度地产产业链一枝独秀，建筑材料、家电、房地产、建筑装饰等行业涨幅都在6%以上；除了地产产业链以外，大健康相关的医药行业表现也较为突出，涨幅在6%左右，符合我们二季度对行业的判断。出于对整个大健康相关行业的看好，我们在三季度维持了较高的股票仓位；在具体标的上，我们重点配置了医药商业、CRO、国企改革、慢病管理等符合未来健康产业发展方向的个股上。三季度本基金虽然回撤较小，但在地产产业链上配置较低，因此整体略跑输指数。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年9月30日，本报告期富安达健康人生灵活配置混合份额净值为1.0031元，净值增长率为0.61%，同期业绩比较基准增长率为2.71%。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	182,701,371.56	78.90
	其中：股票	182,701,371.56	78.90



Click Here to upgrade to Unlimited Pages and Expanded Features

		—	—
		—	—
	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	29,000,000.00	12.52
	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	17,908,170.58	7.73
8	其他资产	1,955,178.42	0.84
9	合计	231,564,720.56	100.00

注：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	—	—
C	制造业	118,495,259.63	53.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	24,510.48	0.01
F	批发和零售业	43,170,176.59	19.32
G	交通运输、仓储和邮政业	4,475,814.20	2.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,494,210.66	0.67
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—

		—	—
		—	—
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	15,041,400.00	6.73
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	182,701,371.56	81.76

### 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	002589	瑞康医药	396,500	13,048,815.00	5.84
2	002626	金达威	800,443	12,438,884.22	5.57
3	002004	华邦健康	1,200,000	11,448,000.00	5.12
4	300123	太阳鸟	665,500	10,035,740.00	4.49
5	600867	通化东宝	430,000	9,769,600.00	4.37
6	600833	第一医药	517,500	9,542,700.00	4.27
7	300091	金通灵	632,200	9,103,680.00	4.07
8	300347	泰格医药	280,000	8,988,000.00	4.02
9	000028	国药一致	123,396	8,853,663.00	3.96
10	002094	青岛金王	340,000	8,710,800.00	3.90

### 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



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。

5.10 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，基金投资的前十名  
证券的发行主体在报告编制日前一年内除金通灵（300091）外，没有受到公开谴责、处  
罚。

江苏金通灵流体机械科技股份有限公司（以下简称“金通灵”）高级管理人员冯兰江先生  
于2015年9月28日、金振明先生于2015年9月30日出现违反规定买卖金通灵股票的行为。  
金通灵对冯兰江先生、金振明先生做出警告处分，并分别处罚1万元；公司董事会依法  
收回冯兰江先生本次短线交易差价金额所得201元；冯兰江先生、金振明先生承诺所持  
的公司股票在6个月内不再进行交易。

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提  
下，经公司审慎研究评估，将该股票纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关  
的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

单位：人民币元

		金额
		196,847.40
2	应收证券清算款	1,752,660.13
3	应收股利	—
4	应收利息	4,979.22
5	应收申购款	691.67
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,955,178.42

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300123	太阳鸟	10,035,740.00	4.49	重大事项
2	002094	青岛金王	8,710,800.00	3.90	重大资产重组

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	269,474,108.90
报告期期间基金总申购份额	372,380.49
减：报告期期间基金总赎回份额	47,061,485.21
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	222,785,004.18

§ 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

页	9,999,000.00
	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.49

注：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

1. 2016年7月1日，富安达基金管理有限公司2016年6月30日基金净值公告；
2. 2016年7月8日，富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一六年第一号)(摘要)；
3. 2016年7月8日，富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一六年第一号)；
4. 2016年7月18日，富安达基金管理有限公司关于参加兴业证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告；
5. 2016年7月20日，富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2016年第2季度报告；
6. 2016年8月26日，富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告(摘要)；
7. 2016年8月26日，富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告；
8. 2016年9月13日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加华龙证券股份有限公司为代销机构并参与费率优惠活动的公告；
9. 2016年9月13日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加光大证券股份有限公司为代销机构并参与费率优惠活动的公告；
10. 2016年9月20日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资手续费率优惠的公告。

## § 9 备查文件目录

活配置混合型证券投资基金设立的文件：

- 《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 《富安达健康人生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](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇一六年十月二十四日