

# 富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月25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	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	8
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	8
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	9
5.1 报告期末基金资产组合情况	9
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	10
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	11
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	11
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	11
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	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	12
5.11 投资组合报告附注	12
§6 开放式基金份额变动	13
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	13
§8 影响投资者决策的其他重要信息	13
8.1 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
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§9 备查文件目录	14
9.1 备查文件目录	14
9.2 存放地点	14
9.3 查阅方式	14

## § 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。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月24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2022年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富安达稳健配置6个月持有期混合
基金主代码	015047
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年05月17日
报告期末基金份额总额	219,964,614.74份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产长期稳定回报。
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、衍生工具、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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+上证国债指数收益率×85%
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	中国农业银行股份有限公司

### § 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（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
1. 本期已实现收益	-8,182,011.06
2. 本期利润	-8,333,489.78
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0379
4. 期末基金资产净值	212,063,435.34
5. 期末基金份额净值	0.9641

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本基金《基金合同》生效日为2022年5月17日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

#### 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

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	-3.78%	0.27%	-1.40%	0.14%	-2.38%	0.13%
自基金合同生效起至今	-3.59%	0.23%	0.93%	0.15%	-4.52%	0.08%

##### 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

富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年05月17日-2022年09月30日)

注：①本基金《基金合同》生效日为2022年5月17日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

②根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2022年11月16日。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## § 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		
吴战峰	本基金的基金经理、公司投资研究部总监	2022-05-17	-	27年	硕士。历任中大投资公司投资部经理，平安证券资产管理部投资经理，招商证券研发中心高级分析师，国信证券研究所首席分析师，国投瑞银基金高级组合经理，国泰基金基金经理，天治基金基金经

					理、总经理助理兼研究总监。2015年10月加入富安达基金管理有限公司任投资研究部总监。2016年1月起任富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达科技领航混合型证券投资基金(2020年06月17日至2021年09月22日期间)、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达成长价值一年持有期混合型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。
李飞	本基金的基金经理、多资产投资副总监(主持工作)	2022-05-17	-	18年	博士。历任上海应用技术学院财政经济系教师;聚源数据有限责任公司研究发展中心项目经理;国盛证券有限责任公司投资研究部高级宏观债券研究员;金元惠理基金管理有限公司投资部基金经理。2012年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年7月起任富安达增强收益债券型证券投资基金的基金经理、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理(2013年10月25日至2016年10月25日期间)、富安

					达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理(2016年5月11日至2018年5月21日期间)、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。
康佳燕	本基金的基金经理、固定收益部总监助理	2022-07-21	-	16年	硕士。历任工银安盛人寿保险有限公司财务部投资分析,泰信基金管理有限公司基金会计;浦银安盛基金管理有限公司基金会计、债券交易员、货币基金经理、专户投资经理;南洋商业银行固定收益部投资经理。2021年加入富安达基金管理有限公司。2021年12月起任富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期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》中关于证券投资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、《富安达稳健配置6个月持有期混合型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，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，国内经济数据弱恢复，央行在8月中旬进行了降息操作，叠加二季度发行的地方债资金落地进入实体经济，银行间市场流动性充裕，资金利率显著下行。在这些有利因素支撑下，三季度债券市场收益率呈震荡下行走势。同期股票市场则呈先扬后抑的走势，7月市场热点板块较多，资金保持活跃；8月中旬后新能源板块出现了一些利空因素，加之海外通胀高企，以美联储为主导的多个主要经济体快速大幅加息，美债和欧债利率快速上升，美股持续下跌，国内股市也出现下跌，且风格切换较频繁。

本基金5月中旬成立后，初期主要通过交易所逆回购和同业存款做好资金管理。6月下旬产品有一定安全垫后，本基金增加了一些股票仓位，结构上以高股息低估值大盘蓝筹为主。但随着7月后央行连续缩量逆回购，临近中报季且多地疫情散发，断供断贷事件的发生也对银行、建材等相关个股造成拖累。7月本基金集中配置了银行间市场中票和政金债。随着8月中旬央行下调MLF利率，市场流动性更加充裕，本基金提升了一定的权益仓位。但市场在8月下旬显著调整，且风格有高低切换的动向。由于当时判断是行业个股层面冲击，未能及时降低仓位。9月后美联储官员持续发布鹰派立场，同时俄乌冲突升级，美国进一步对中国高新技术产业进行限制，市场出现了较为明显的调整。9月中下旬，本基金降低了权益仓位，同时在结构上更偏重于防御。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达稳健配置6个月持有期混合基金份额净值为0.9641元，本报告期内，基金份额净值增长率为-3.78%，同期业绩比较基准收益率为-1.40%。

### 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	20,173,891.45	9.45
	其中：股票	20,173,891.45	9.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	167,853,490.97	78.65
	其中：债券	167,853,490.97	78.65
	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	22,982,307.73	10.77
	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	1,747,906.04	0.82
8	其他资产	656,550.69	0.31
9	合计	213,414,146.88	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	2,484,384.00	1.17
C	制造业	4,714,326.00	2.22
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	2,920,982.00	1.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,544,038.00	1.67
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,414,525.00	1.14
J	金融业	4,095,636.45	1.93
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	20,173,891.45	9.51

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	601398	工商银行	651,567	2,834,316.45	1.34
2	600900	长江电力	73,300	1,666,842.00	0.79
3	601088	中国神华	45,000	1,423,800.00	0.67
4	000933	神火股份	76,000	1,276,040.00	0.60
5	601006	大秦铁路	187,200	1,267,344.00	0.60
6	601728	中国电信	330,700	1,266,581.00	0.60
7	601939	建设银行	228,500	1,261,320.00	0.59
8	000651	格力电器	38,700	1,255,041.00	0.59
9	600461	洪城环境	171,800	1,254,140.00	0.59
10	600377	宁沪高速	172,800	1,242,432.00	0.59

### 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	3,245,232.22	1.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,765,265.75	28.65
	其中：政策性金融债	40,475,484.93	19.09
4	企业债券	9,997,970.96	4.71
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,214,827.40	28.87
7	可转债（可交换债）	32,630,194.64	15.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	167,853,490.97	79.15

#### 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	220312	22进出12	300,000	30,339,279.45	14.31
2	102280646	22南通城建MTN001	200,000	20,596,870.14	9.71
3	102280392	22华为MTN003	200,000	20,453,797.26	9.65
4	2228037	22交通银行小微债01	200,000	20,289,780.82	9.57
5	102281588	22临港经济MTN001	200,000	20,164,160.00	9.51

#### 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，本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行、交通银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

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	28,805.60
2	应收证券清算款	627,745.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	656,550.69

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	8,526,104.99	4.02
2	113042	上银转债	7,891,848.60	3.72
3	113050	南银转债	3,485,355.86	1.64
4	113051	节能转债	2,169,275.81	1.02
5	110077	洪城转债	2,128,163.99	1.00

6	110053	苏银转债	2,120,453.47	1.00
7	113044	大秦转债	2,120,042.46	1.00
8	123107	温氏转债	2,117,629.91	1.00
9	110056	亨通转债	2,071,319.55	0.98

### 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

报告期期初基金份额总额	219,943,007.80
报告期期间基金总申购份额	21,606.94
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	219,964,614.74

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

本报告期内基金管理人未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

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 2022年7月1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
- 2022年7月8日，富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购（转换、定期定额投资）业务公告
- 2022年7月8日，富安达基金管理有限公司关于参加光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告

4. 2022年7月22日，富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告

5. 2022年7月25日，富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新

6. 2022年7月25日，富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二二年第一号）

7. 2022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

8. 2022年9月19日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京创金启富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

9. 2022年9月21日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加泰信财富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

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金注册的文件：

《富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》；

《富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；

《富安达稳健配置6个月持有期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

2022年10月25日