

富安达策略精选灵活配置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:交通银行股份有限公司

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遵规守信情况的说明	6
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	8
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	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	11
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	11
5.11 投资组合报告附注	11
§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	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
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	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

§ 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	富安达策略精选混合
基金主代码	710002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年04月25日
报告期末基金份额总额	21,998,433.96份
投资目标	本基金紧跟中国经济发展趋势，在充分控制风险的前提下，通过投资具有持续增长潜力且具有合理估值的上市公司，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、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，判断和预测经济发展周期及趋势，综合比较大类资产的收益及风险情况，确定债券、股票、现金等大类资产配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金。一般情况，其风险和收益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（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
1. 本期已实现收益	359,535.06
2. 本期利润	-3,812,890.78
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1727
4. 期末基金资产净值	58,704,970.40
5. 期末基金份额净值	2.6686

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 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	-6.12%	1.08%	-8.09%	0.49%	1.97%	0.59%
过去六个月	-3.48%	1.10%	-4.38%	0.65%	0.90%	0.45%
过去一年	-20.71%	1.08%	-10.60%	0.65%	-10.11%	0.43%
过去三年	4.01%	1.25%	6.94%	0.69%	-2.93%	0.56%
过去五年	12.86%	1.17%	12.08%	0.70%	0.78%	0.47%
自基金合同生效起至今	176.66%	1.47%	57.14%	0.78%	119.52%	0.69%

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

富安达策略精选灵活配置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
(2012年04月25日-2022年09月30日)



§ 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		
朱义	本基金的基金经理	2019-09-10	2022-07-05	19年	硕士。历任金元顺安基金管理有限公司风险管理专员；上投摩根基金管理有限公司高级风险管理经理；富安达基金管理有限公司监察稽核部副总监、投资研究部总监助理兼基金经理助理。2018年4月起任富安长达盈灵活配置混合型证券投资基金（2018年04月13日至2022年07月21日）、富安达新动力灵

					活配置混合型证券投资基金（2018年11月30日至2022年07月05日）、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金（2018年11月30日至2022年07月21日）、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金（2019年09月10日至2022年07月05日）的基金经理。
栾庆帅	本基金的基金经理	2022-07-05	-	14年	硕士。历任中山证券有限责任公司化工行业研究员；国民信托有限公司研究员。2013年加入富安达基金管理有限公司任高级行业研究员。2021年7月起任富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达先进制造混合型发起式证券投资基金、富安达策略精选灵活配置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的基金经理。

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、《富安达策略精选灵活配置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

3季度市场整体偏弱,疫情的反复以及断贷事件的冲击导致市场对经济预期偏悲观,在流动性偏宽松的环境下,8月上旬之前小票成长表现较好。但随着流动性的边际收敛以及8月的信贷数据的落地,市场对于经济保底预期进一步提升,地产成为经济保底的期待方向,而我们也后续看到了一系列政策的落地,比如下调部分城市首套房贷款利率下限、下调住房公积金贷款利率以及给予换购住房个税优惠等,地产政策已经从前期的“因城施策”转向范围更广“自上而下”的调控,9月份更是逐步看到了地产销售数据的边际改善,我们认为这是地产重新反弹的核心原因。另外,国常会上专项再贷款与财政贴息配套支持部分领域设备更新改造等政策的推出,引起消费、医药也出现了一波反弹。

本基金报告期内更多是对仓位进行调整和优化,由于市场没有比较明确的主线,我们更多是把前期的仓位调减,并适当增加了一些新能源和智能驾驶的标的。由于整体比较均衡,因此净值的波动会相对平缓。

展望后市,市场整体仍比较疲软,海外加息预期的波动对汇率及国内市场或仍将产生一定影响,但国内基本面和流动性逐步改善,房地产政策也在持续推进,有助于购买者情绪的恢复。人民币汇率阶段性企稳,流动性节后也出现了改善,DR007回落至1.4左右,表明节后市场资金面跨季回归后仍比较宽松,市场估值水平已回到历史底部,我们认为市场短期最大的问题或许还是在于情绪。总体而言,经济企稳信号在增强,逢低加仓或是可以考虑的选择,方向上可能除了适当增配房地产和建筑、建材标的外,还可能增加一些消费的优质标的,为明年布局做准备。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达策略精选混合基金份额净值为2.6686元，本报告期内，基金份额净值增长率为-6.12%，同期业绩比较基准收益率为-8.09%。

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	29,743,548.22	49.71
	其中：股票	29,743,548.22	49.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,517,060.43	12.56
	其中：债券	7,517,060.43	12.56
	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	-10,060.27	-0.02
	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	10,522,325.74	17.59
8	其他资产	12,062,707.61	20.16
9	合计	59,835,581.73	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	484,000.00	0.82
B	采矿业	1,112,962.26	1.90

C	制造业	25,629,103.96	43.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	329,730.00	0.56
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	244,240.00	0.42
H	住宿和餐饮业	403,550.00	0.69
I	信息传输、软件和信息技术服务业	401,062.00	0.68
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	1,138,900.00	1.94
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	29,743,548.22	50.67

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	002475	立讯精密	45,100	1,325,940.00	2.26
2	300757	罗博特科	30,000	1,231,200.00	2.10
3	300973	立高食品	14,100	1,215,984.00	2.07
4	003022	联泓新科	30,000	1,199,400.00	2.04

5	300384	三联虹普	70,000	1,138,900.00	1.94
6	002943	宇晶股份	19,000	1,022,200.00	1.74
7	002126	银轮股份	81,900	1,009,827.00	1.72
8	600760	中航沈飞	16,300	993,485.00	1.69
9	300767	震安科技	20,000	956,600.00	1.63
10	688630	芯碁微装	14,000	931,000.00	1.59

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	7,517,060.43	12.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,517,060.43	12.80

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	019656	21国债08	56,000	5,679,156.38	9.67
2	019664	21国债16	18,000	1,837,904.05	3.13

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内受到公开谴责、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	45,624.87
2	应收证券清算款	12,011,178.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,904.66
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	12,062,707.61

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

报告期期初基金份额总额	22,158,552.52
-------------	---------------

报告期期间基金总申购份额	312,273.37
减：报告期期间基金总赎回份额	472,391.93
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	21,998,433.96

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6日，富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告
- 2022年7月7日，富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新
- 2022年7月7日，富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二二年第二号）
- 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
- 2022年7月20日，富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2022年第2季度报告
- 2022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
- 2022年8月29日，富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2022 年中期报告
- 2022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
- 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
- 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、中国证监会批准富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件：
《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
《富安达策略精选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）查阅。

富安达基金管理有限公司

2022年10月25日