

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

2017年第3季度报告

2017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：2017年10月27日

## § 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2017年10月25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2017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	118,095,815.26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。
业绩比较基准	沪深 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（2017年7月1日-2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	2,272,454.60
2. 本期利润	3,538,829.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0268
4. 期末基金资产净值	123,633,377.69
5. 期末基金份额净值	1.0469

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	3.07%	0.58%	2.92%	0.35%	0.15%	0.23%

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：

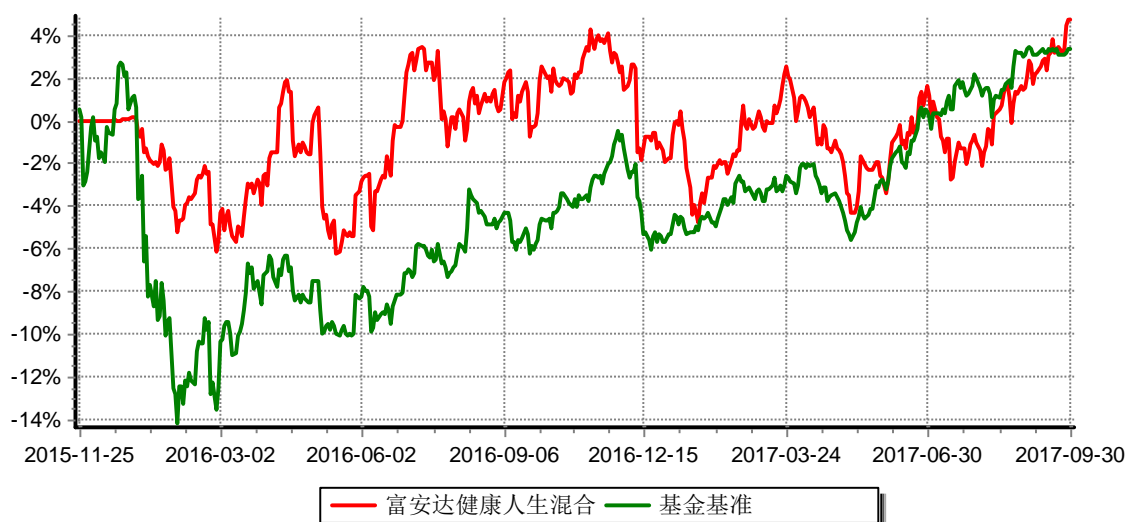
$$\text{Return } t = 60\% \times [\text{沪深300指数}_t / \text{沪深300指数}(t-1) - 1] + 40\% \times [\text{中债总财富总指数}_t / \text{中债总财富总指数}(t-1) - 1]$$

$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中,  $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ,  $T$  表示时间截至日。

### 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

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金  
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年11月25日-2017年9月30日)



注: 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		
李守峰	本基金的基金经理	2015年12月25日	—	7年	博士。历任万联证券研究所医药研究员。2013年3月加入富安达基金管理有限公司任行业研究员。
纪青	本基金的基金经理	2016年12月16日	—	9年	硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。2013年4月加入富安达基金管理有限公司任高级金

					融工程研究员。
--	--	--	--	--	---------

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遵规守信情况的说明

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

17年三季度A股整体震荡向上，上证综指上涨4.9%，深证成指上涨2.5%，中小板指数上涨8.86%，创业板指数上涨2.69%。分行业看，周期类股票表现要好于价值类股票，有色、钢铁、银行、食品饮料等行业涨幅居前，而传媒、纺织服装、公用事业等板块下跌，健康相关的医药板块由于中报出现了较多的业绩低于预期的情况因而三季度下跌0.85%，位于所有行业的中下游。三季度我们调整了部分基本面出现恶化的个股的仓位，并将仓位配置在业绩预期良好的个股上。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017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1.0469元,净值增长率为3.07%,同期业绩比较基准增长率为2.92%。

#### 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	106,155,412.50	85.36
	其中: 股票	106,155,412.50	85.36
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	10,000,000.00	8.04
	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	6,927,867.97	5.57
8	其他资产	1,274,188.66	1.02
9	合计	124,357,469.13	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	81,559,210.50	65.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,101,000.00	1.70
F	批发和零售业	8,136,480.00	6.58
G	交通运输、仓储和邮政业	10,694,600.00	8.65
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
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	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	3,664,122.00	2.96
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	106,155,412.50	85.86

### 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	000661	长春高新	55,000	8,170,250.00	6.61
2	000538	云南白药	67,000	6,076,900.00	4.92
3	002773	康弘药业	110,300	5,734,497.00	4.64

4	600285	羚锐制药	430,000	5,043,900.00	4.08
5	600572	康恩贝	700,156	4,950,102.92	4.00
6	300274	阳光电源	290,000	4,880,700.00	3.95
7	600887	伊利股份	175,000	4,812,500.00	3.89
8	600029	南方航空	550,000	4,548,500.00	3.68
9	600521	华海药业	200,000	4,484,000.00	3.63
10	600998	九州通	204,000	4,206,480.00	3.40

#### 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。

#### 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，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库。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	76,478.96
2	应收证券清算款	1,165,650.54
3	应收股利	—
4	应收利息	8,688.03
5	应收申购款	2,393.28
6	其他应收款	—
7	待摊费用	20,977.85
8	其他	—
9	合计	1,274,188.66

#### 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	144,218,453.49
报告期期间基金总申购份额	341,301.10
减：报告期期间基金总赎回份额	26,463,939.33
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	118,095,815.26

## § 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	—
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（%）	8.47

## 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

### 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

1. 2017年7月1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费率优惠活动的公告
2. 2017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）（二〇一七年第一号）正文及摘要
3. 2017年7月19日，富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2017年第2季度报告
4. 2017年8月24日，富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告正文及摘要

## § 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健康人生灵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  
二〇一七年十月二十七日