

富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金

2019 年第 3 季度报告

2019 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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2019 年 10 月 23 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..... | 6 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析..... | 6 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现..... | 7 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 7 |
| §5 投资组合报告..... | 7 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 7 |
| 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..... | 8 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 9 |
| 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..... | 9 |
| 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..... | 9 |
| 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 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 11 |
| §9 备查文件目录..... | 12 |
| 9.1 备查文件目录..... | 12 |
| 9.2 存放地点..... | 12 |
| 9.3 查阅方式..... | 12 |

§ 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。基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年10月18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2019年07月01日起至09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 富安达长盈混合 |
| 基金主代码 | 002584 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年05月19日 |
| 报告期末基金份额总额 | 169,410,978.91份 |
| 投资目标 | 在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，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、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×60%+中国债券总指数收益率×40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |

§ 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（2019年07月01日 - 2019年09月30日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 1,197,814.25 |
| 2. 本期利润 | 1,243,640.79 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0096 |
| 4. 期末基金资产净值 | 171,790,014.22 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.014 |

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 | 0.00% | 0.60% | 0.45% | 0.57% | -0.45% | 0.03% |

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

富安达长盈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



注：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2018年11月18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 | | |
| 朱义 | 本基金的基金经理 | 2018-04-13 | - | 16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、研究发展部研究总监助理兼基金经理助理。2018年4月起任富安达长盈灵活配 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 置混合型基金、富安达新动力灵活配置混合型基金、富安达行业轮动灵活配置混合型基金、富安达策略精选灵活配置混合型基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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、《富安达长盈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

三季度宏观经济仍有较大下行压力，但逆周期政策逐步出台：贷款利率“两轨合一轨”，引导降低实际融资利率；推出深圳先行示范区、多个自由贸易试验区，进一步推动对外开放。总体政策更注重精准性，寻找高科技作为未来经济新增长点。从上市公司中报和三季度报前瞻来看，尽管总体经济在向下，但仍有结构性亮点。本基金三季度保持

了较高仓位，除了二季度配置的金融、地产等低估值以及家电、食品饮料等消费类行业，增配了5G、华为产业链以及云计算等科技股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为1.014元；本报告期基金份额净值增长率为0.00%，同期业绩比较基准收益率为0.45%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。针对该情形，本基金管理人的解决方案为：稳健运作，做好基金业绩，稳定基金规模；积极沟通，整合资源，有序推进营销工作。上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。本报告期内，本基金规模已超过五千万，未再次出现上述情形。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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 | 66,279,724.18 | 38.44 |
| | 其中：股票 | 66,279,724.18 | 38.44 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 7,750,008.80 | 4.50 |
| | 其中：债券 | 7,750,008.80 | 4.50 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 97,636,474.08 | 56.63 |
| 8 | 其他资产 | 736,875.00 | 0.43 |
| 9 | 合计 | 172,403,082.06 | 100.00 |

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 | 2,426,898.84 | 1.41 |
| C | 制造业 | 19,156,148.56 | 11.15 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 2,634,718.04 | 1.53 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 551,578.00 | 0.32 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 891,441.40 | 0.52 |
| J | 金融业 | 37,588,231.34 | 21.88 |
| K | 房地产业 | 1,798,446.60 | 1.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,079,496.00 | 0.63 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 152,765.40 | 0.09 |
| 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 | 66,279,724.18 | 38.58 |

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 | 601318 | 中国平安 | 129,800 | 11,297,792.00 | 6.58 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 5,900 | 6,785,000.00 | 3.95 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 136,000 | 4,726,000.00 | 2.75 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 195,000 | 3,418,350.00 | 1.99 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 36,913 | 2,978,140.84 | 1.73 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 123,200 | 2,769,536.00 | 1.61 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 71,149 | 2,029,169.48 | 1.18 |
| 8 | 601328 | 交通银行 | 355,900 | 1,939,655.00 | 1.13 |
| 9 | 600016 | 民生银行 | 320,700 | 1,930,614.00 | 1.12 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 494,299 | 1,710,274.54 | 1.00 |

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 | 2,629,508.80 | 1.53 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 5,120,500.00 | 2.98 |
| | 其中：政策性金融债 | 5,120,500.00 | 2.98 |
| 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 | 7,750,008.80 | 4.51 |

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 | 018008 | 国开1802 | 50,000 | 5,120,500.00 | 2.98 |
| 2 | 010303 | 03国债(3) | 25,820 | 2,629,508.80 | 1.53 |

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 | 84,140.36 |
| 2 | 应收证券清算款 | 537,166.33 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 115,368.61 |
| 5 | 应收申购款 | 199.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 736,875.00 |

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 | 8,786,213.30 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 161,883,082.90 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,258,317.29 |
| 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 | 169,410,978.91 |

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。

§ 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

| 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 | 20190715-20190729 | 0.00 | 29,939,121.76 | 0.00 | 29,939,121.76 | 17.67% |
| | 2 | 20190715-20191715 | 0.00 | 24,949,101.80 | 0.00 | 24,949,101.80 | 14.73% |
| 个人 | 1 | 20190716-20190930 | 0.00 | 59,819,541.38 | 0.00 | 59,819,541.38 | 35.31% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 当持有基金份额比例达到或超过20%的投资者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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2019年7月1日，富安达基金管理有限公司关于参加中信证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告
- 2、2019年7月1日，富安达基金管理有限公司2019年6月30日基金净值公告
- 3、2019年7月17日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加中国人寿为代销机构并开通定投及转换业务的公告
- 4、2019年7月18日，富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金2019年第二季度报告
- 5、2019年7月29日，富安达基金关于参加安信证券费率优惠活动的公告（放开费率折扣限制）
- 6、2019年8月27日，富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告
- 7、2019年8月27日，富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告摘要

§ 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长盈灵活配置混合型证券投资基金设立的文件：
 - 《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
 - 《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
 - 《富安达长盈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
2019年10月23日