

# 富安达睿选增利债券型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024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:2024年10月24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	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
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	9
4.5 报告期内基金的业绩表现	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	9
§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	10
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	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	11
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	12
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	12
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	12
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	12
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	14
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	14
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	14
§8 影响投资者决策的其他重要信息	14
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	14
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	14
§9 备查文件目录	15
9.1 备查文件目录	15
9.2 存放地点	15
9.3 查阅方式	15

## §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2024年10月23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2024年7月1日起至9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	富安达睿选增利债券
基金主代码	019798
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年03月12日
报告期末基金份额总额	10,053,275.31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，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金管理人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，判断和预测经济发展周期及趋势，构建和调整固定收益证券投资组合。</p> <p>本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合的配置和投资。根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置，在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业的研究以及相应的财务分析和非财务分析，"自上而下"在各类债券资产类别之间进行类属配置，精选个券并严控信用风险。在市场收益率</p>

	以及个券收益率变化过程中，灵活运用骑乘策略、回购策略等增强组合收益。	
业绩比较基准	中债总财富（1-3年）指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于混合型基金、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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	富安达睿选增利债券A	富安达睿选增利债券C
下属分级基金的交易代码	019798	019799
报告期末下属分级基金的份额总额	2,628,254.53份	7,425,020.78份

### §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(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	富安达睿选增利债券A	富安达睿选增利债券C
1.本期已实现收益	-15,872.01	-40,073.11
2.本期利润	-11,252.46	-27,306.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0036	-0.0016
4.期末基金资产净值	2,620,847.50	7,398,213.32
5.期末基金份额净值	0.99718177	0.99638958

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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2024年3月12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

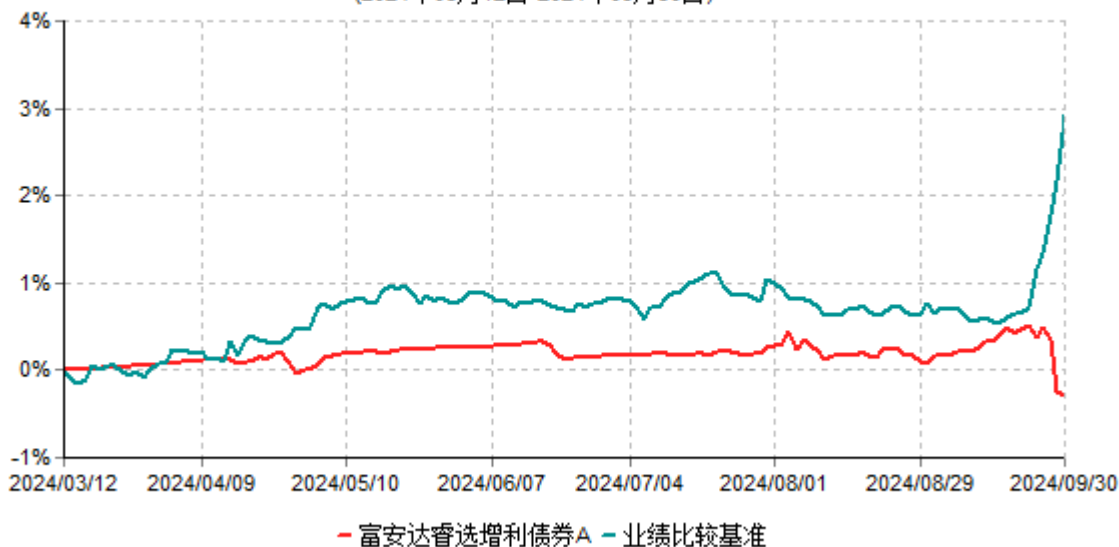
## 富安达睿选增利债券A净值表现

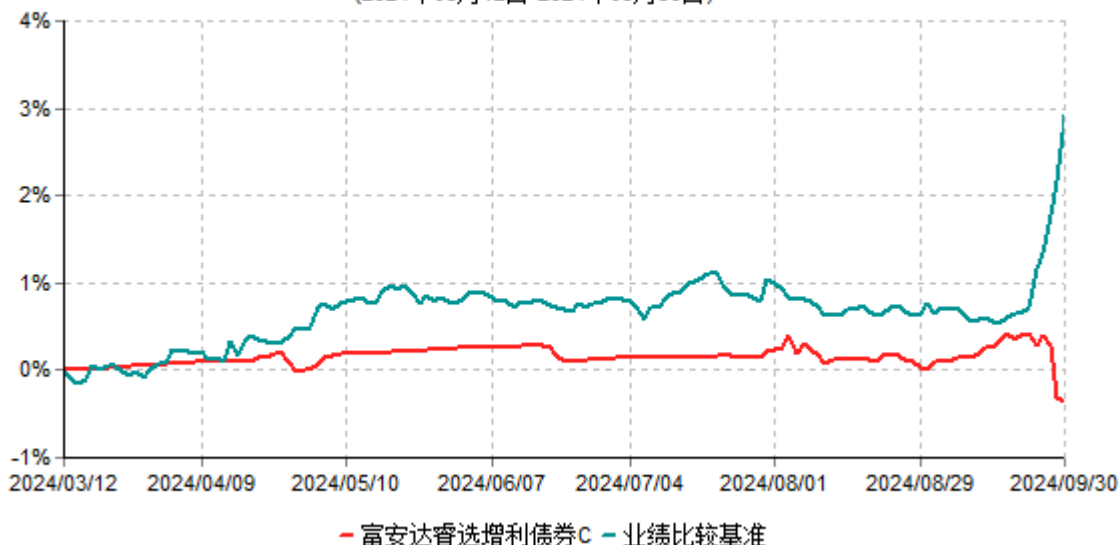
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.44%	0.09%	2.14%	0.15%	-2.58%	-0.06%
过去六个月	-0.36%	0.07%	2.86%	0.12%	-3.22%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-0.28%	0.07%	2.93%	0.11%	-3.21%	-0.04%

## 富安达睿选增利债券C净值表现

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	-0.49%	0.09%	2.14%	0.15%	-2.63%	-0.06%
过去六个月	-0.43%	0.07%	2.86%	0.12%	-3.29%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-0.36%	0.07%	2.93%	0.11%	-3.29%	-0.04%

## 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

富安达睿选增利债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年03月12日-2024年09月30日)

富安达睿选增利债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年03月12日-2024年09月30日)

注：①本基金《基金合同》生效日为2024年3月12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2024年9月  
11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		
赵恒毅	本基金的基金经理、 固定收益部总监	2024- 03-22	-	19年	硕士。历任通用技术集团投 资有限公司资产管理部债 券研究员；富国基金管理有 限公司固定收益部债券研 究员、债券基金经理；海富 通基金管理有限公司债券 基金经理、债券基金部副总 监；中欧基金管理有限公司 纯债专户部资深投资经理； 益民基金副总经理兼固定 收益部总监。2022年加入富 安达基金管理有限公司，现

					任固定收益部总监、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达睿选增利债券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	2024-03-12	-	18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任固定收益部总监助理。现任富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达富祥利率债债券型证券投资基金、富安达富禧纯债30天持有期债券型证券投资基金、富安达睿选增利债券型证券投资基金的基金经理。曾任富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理。
栾庆帅	本基金的基金经理	2024-03-12	-	16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。现任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、富安达睿选增利债券型证券投资基金的基金经理。曾任富安达优势成长混合型证券投资基金、富安长达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达成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。
--	--	--	--	--	---

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；
- 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、《富安达睿选增利债券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,未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,国内经济增长保持韧性,但内生动能偏弱。中国PMI数据持续位于荣枯线以下,不过9月的数据已接近50。工业增加值、社会消费品零售总额和固定资产投资增速总体上呈下行态势。出口仍然是经济中最亮的部分,贸易顺差维持在较高水平。物价保持在较低的水平,货币和社融增长速度放缓。三季度债市收益率波动较大,央行多次提示长债风险,但收益率仍震荡下行。直到9月24日国新办新闻发布会后,市场悲观预期改变,收益率快速上行。三季度股市先抑后扬,前期大盘低估值、高分红、稳定行业表现较好。9月24日后股市快速上涨,超跌和成长板块领先。转债市场总体走势跟随股市,7月至8月情绪低落,同时还伴随有信用风险担忧,9月24日后也普遍反弹。

报告期内,本基金债券部分主要配置在利率债,久期保持在适中的水平,杠杆运用较少。权益部分仓位总体上控制在较低的水平,并以高等级转债为主。9月下旬,适当提高了转债和股票的配置比例。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达睿选增利债券A基金份额净值为0.99718177元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-0.44%,同期业绩比较基准收益率为2.14%;截至报告期末富安达睿选增利债券C基金份额净值为0.99638958元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-0.49%,同期业绩比较基准收益率为2.14%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金存在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	445,677.91	4.21
	其中：股票	445,677.91	4.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,788,056.03	83.09
	其中：债券	8,788,056.03	83.09
	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	976,731.26	9.23
8	其他资产	366,114.75	3.46
9	合计	10,576,579.95	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	445,677.91	4.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	-	-
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	445,677.91	4.45

### 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	300740	水羊股份	7,600	103,968.00	1.04
2	301266	宇邦新材	2,800	103,600.00	1.03
3	600019	宝钢股份	14,700	102,018.00	1.02
4	688036	传音控股	687	74,147.91	0.74
5	300308	中际旭创	400	61,944.00	0.62

### 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	8,213,593.37	81.98
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）	574,462.66	5.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,788,056.03	87.71

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。

### 5.5 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	019739	24国债08	33,000	3,357,392.88	33.51
2	019741	24国债10	20,000	2,025,290.41	20.21
3	019740	24国债09	18,000	1,814,087.34	18.11
4	019743	24国债11	10,000	1,016,822.74	10.15
5	113060	浙22转债	710	104,791.27	1.05

### 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	8,662.39
2	应收证券清算款	357,452.36
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	366,114.75

## 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	113060	浙22转债	104,791.27	1.05
2	123107	温氏转债	100,935.04	1.01
3	113050	南银转债	100,563.24	1.00
4	113044	大秦转债	99,756.77	1.00
5	113066	平煤转债	98,514.13	0.98
6	110075	南航转债	69,902.21	0.70

## 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

	富安达睿选增利债券A	富安达睿选增利债券C
报告期期初基金份额总额	4,970,343.10	57,803,869.53
报告期期间基金总申购份额	3,796.03	65,400.22
减：报告期期间基金总赎回份额	2,345,884.60	50,444,248.97
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	2,628,254.53	7,425,020.78

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

## §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

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	20240701-20240703	19,978,564.00	-	19,978,564.00	0.00	0.00%
	2	20240701-20240720	20,806,834.50	-	20,806,834.50	0.00	0.00%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人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. 2024年7月6日，富安达基金管理有限公司关于终止直销网上交易平台、微信交易平台开户、认购、申购（含定期定额投资）、基金转换业务的公告

2. 2024年7月11日，富安达基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告

3. 2024年7月18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

4. 2024年7月18日，富安达睿选增利债券型证券投资基金2024年第2季度报告

5. 2024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

6. 2024年8月29日，富安达睿选增利债券型证券投资基金2024年中期报告

7. 2024年9月26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

## §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睿选增利债券型证券投资基金设立的文件：  
《富安达睿选增利债券型证券投资基金招募说明书》；  
《富安达睿选增利债券型证券投资基金基金合同》；  
《富安达睿选增利债券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  
2024年10月24日