

# 富安达增强收益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	7
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	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	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	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	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	12
§6 开放式基金份额变动	14
§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	15
§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	富安达增强收益债券
基金主代码	710301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年07月25日
报告期末基金份额总额	39,774,077.58份
投资目标	本基金将在控制风险与保持资产流动性的基础上，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资回报。
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，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。</p> <p>在进行固定收益类资产配置时，本基金首先通过久期配置、期限结构配置、类属配置策略来实现对固定收益类资产的配置。本基金的股票类资产作为整体基金投资组合管理的辅助工具，为投资人提供适度参与股票市场、获取超额收益的机会。</p>
业绩比较基准	中债总指数收益率×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，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属分级基金的份额总额	19,077,236.85份	20,696,840.73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)	
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
1.本期已实现收益	-680,981.60	-700,021.12
2.本期利润	-276,269.75	-284,509.30
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0144	-0.0141
4.期末基金资产净值	25,328,678.53	26,059,467.01
5.期末基金份额净值	1.3277	1.2591

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。

#### 3.2 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

富安达增强收益债券A净值表现

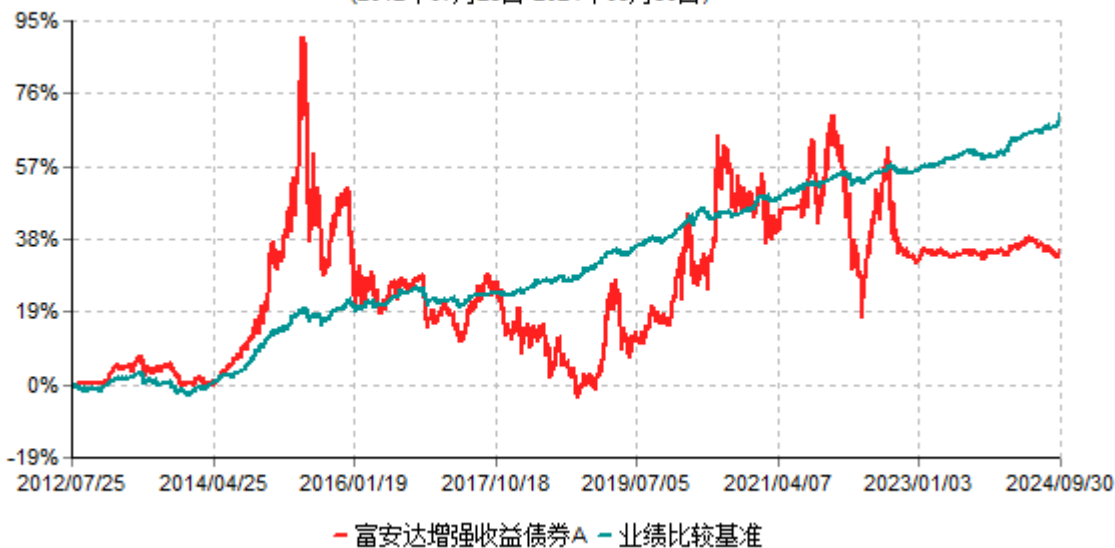
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去三个月	-1.07%	0.27%	2.54%	0.15%	-3.61%	0.12%
过去六个月	-0.53%	0.25%	3.95%	0.12%	-4.48%	0.13%
过去一年	0.60%	0.22%	6.83%	0.11%	-6.23%	0.11%
过去三年	-7.33%	0.84%	11.89%	0.12%	-19.22%	0.72%
过去五年	15.89%	1.02%	24.25%	0.13%	-8.36%	0.89%
自基金合同生效起至今	35.37%	1.00%	70.88%	0.16%	-35.51%	0.84%

## 富安达增强收益债券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	-1.16%	0.27%	2.54%	0.15%	-3.70%	0.12%
过去六个月	-0.73%	0.25%	3.95%	0.12%	-4.68%	0.13%
过去一年	0.20%	0.22%	6.83%	0.11%	-6.63%	0.11%
过去三年	-8.44%	0.84%	11.89%	0.12%	-20.33%	0.72%
过去五年	13.20%	1.02%	24.25%	0.13%	-11.05%	0.89%
自基金合同生效起至今	28.38%	1.00%	70.88%	0.16%	-42.50%	0.84%

## 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

富安达增强收益债券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  
(2012年07月25日-2024年09月30日)

富安达增强收益债券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  
(2012年07月25日-2024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		
郑良海	本基金的基金经理	2022-09-23	-	12年	博士。历任上海电气电站集团订单项目处项目经理；山西证券股份有限公司宏观债券分析师；东兴证券股份有限公司债券高级分析师；财通基金管理有限公司固定收益部债券高级研究员。2022年加入富安达基金管理有限公司，现任富安达增强收益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、富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。
赵恒毅	本基金的基金经理、	2023-	-	19年	硕士。历任通用技术集团投

	固定收益部总监	12-08		<p>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。</p>
--	---------	-------	--	--

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、《富安达增强收益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眼的部分，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，本基金总体上维持了以信用债为主的配置结构，主要标的为高等级中短久期信用债，同时适量参与了利率债交易。股票部分，本基金重点布局高分红和稳定行业，并进行适当分散，仓位总体在适中的水平，9月下旬调整了持仓结构，增加了成长板块的配置。转债部分主要挑选股债平衡型品种，参与了部分风险可控的偏债品种，行业上偏向低估值和弹性板块。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达增强收益债券A基金份额净值为1.3277元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.07%，同期业绩比较基准收益率为2.54%；截至报告期末富安达增强收益债券C基金份额净值为1.2591元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.16%，同期业绩比较基准收益率为2.54%。

#### 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	9,003,361.05	12.83
	其中：股票	9,003,361.05	12.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,742,295.74	77.99
	其中：债券	54,742,295.74	77.99
	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	1,623,156.35	2.31
8	其他资产	4,819,815.17	6.87
9	合计	70,188,628.31	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	254,705.00	0.50
B	采矿业	229,160.00	0.45
C	制造业	7,040,443.05	13.70
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	591,163.00	1.15

J	金融业	629,170.00	1.22
K	房地产业	258,720.00	0.50
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	9,003,361.05	17.52

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。

### 5.2.2 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	601601	中国太保	9,400	367,540.00	0.72
2	600887	伊利股份	12,300	357,561.00	0.70
3	300750	宁德时代	1,400	352,646.00	0.69
4	002517	恺英网络	27,800	330,542.00	0.64
5	301266	宇邦新材	8,900	329,300.00	0.64
6	688036	传音控股	3,042	328,323.06	0.64
7	300740	水羊股份	23,400	320,112.00	0.62
8	300856	科思股份	9,300	315,735.00	0.61
9	688271	联影医疗	2,464	315,392.00	0.61
10	603816	顾家家居	9,900	307,593.00	0.60

### 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	11,955,129.83	23.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	23,702,903.22	46.13
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,164,336.33	10.05
7	可转债（可交换债）	13,919,926.36	27.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,742,295.74	106.53

#### 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	019750	24特国04	90,000	9,225,914.79	17.95
2	102282389	22鄂联投MTN004	30,000	3,142,037.70	6.11
3	185087	21济轨Y5	30,000	3,074,162.30	5.98
4	149671	21厦港01	25,000	2,566,341.10	4.99
5	019631	20国债05	23,000	2,326,084.52	4.53

**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	16,640.93
2	应收证券清算款	4,801,003.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,170.88
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,819,815.17

#### 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	111005	富春转债	524,839.18	1.02
2	118043	福立转债	522,134.58	1.02
3	127081	中旗转债	514,765.43	1.00
4	113632	鹤21转债	512,877.01	1.00
5	118026	利元转债	432,938.36	0.84
6	113668	鹿山转债	425,847.21	0.83
7	127075	百川转2	422,083.08	0.82
8	113060	浙22转债	374,887.09	0.73
9	127099	盛航转债	370,403.88	0.72
10	113676	荣23转债	369,702.27	0.72
11	127103	东南转债	363,760.48	0.71
12	113658	密卫转债	357,153.60	0.70

13	113069	博23转债	316,431.57	0.62
14	123228	震裕转债	307,504.18	0.60
15	123237	佳禾转债	263,066.35	0.51
16	123184	天阳转债	261,296.64	0.51
17	123221	力诺转债	260,714.89	0.51
18	118041	星球转债	256,519.89	0.50
19	127054	双箭转债	256,047.78	0.50
20	111007	永和转债	255,029.13	0.50
21	123208	孩王转债	254,223.32	0.49
22	118037	上声转债	218,475.62	0.43
23	123145	药石转债	217,752.52	0.42
24	123218	宏昌转债	217,679.06	0.42
25	123212	立中转债	215,804.63	0.42
26	123227	雅创转债	215,045.76	0.42
27	123191	智尚转债	214,978.31	0.42
28	127053	豪美转债	214,836.70	0.42
29	113663	新化转债	214,328.42	0.42
30	113637	华翔转债	213,716.27	0.42
31	118028	会通转债	213,650.58	0.42
32	113673	岱美转债	212,892.81	0.41
33	123131	奥飞转债	212,765.18	0.41
34	123182	广联转债	212,757.78	0.41
35	111008	沿浦转债	212,378.44	0.41
36	111012	福新转债	211,258.47	0.41
37	127020	中金转债	209,822.80	0.41
38	123119	康泰转2	209,410.55	0.41
39	123213	天源转债	209,306.00	0.41
40	113662	豪能转债	209,089.81	0.41
41	123147	中辰转债	209,062.21	0.41
42	113669	景23转债	208,522.79	0.41
43	123158	宙邦转债	208,083.71	0.40
44	127043	川恒转债	207,270.39	0.40
45	123224	宇邦转债	206,388.95	0.40

**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

	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
报告期期初基金份额总额	19,237,338.12	20,134,876.85
报告期期间基金总申购份额	141,896.94	910,681.82
减：报告期期间基金总赎回份额	301,998.21	348,717.94
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	19,077,236.85	20,696,840.73

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**

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	20240701-20240930	20,623,543.25	-	-	20,623,543.25	51.85%
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. 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，富安达增强收益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，富安达增强收益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增强收益债券型证券投资基金设立的文件：

《富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书》；

《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》；

《富安达增强收益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**