富安达增强收益债券型证券投资基金

2018年第四季度报告

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:2019年01月19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2019年1月17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2018年10月1日起至12月31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	46,999,125.31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	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PEO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。 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。
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,属于具有中低风险收益特征的基金品种,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	19,302,937.51份 / 27,696,187.80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(2018年10月01日 - 2018年12月31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	-296,244.06	-442,945.92
2.本期利润	-971,520.38	-1,387,116.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0510	-0.0500
4.期末基金资产净值	18,796,219.11	26,252,807.48
5.期末基金份额净值	0.9737	0.9479

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

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	-4.94%	0.83%	1.80%	0.16%	-6.74%	0.67%

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	-5.03%	0.83%	1.80%	0.16%	-6.83%	0.67%

①本基金业绩比较基准为:10%×沪深300指数+90%×中债总财富总指数,

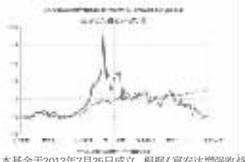
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =10%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+90%×[中债总财富总指数t / 中债总财富总指数(t-1) -1]

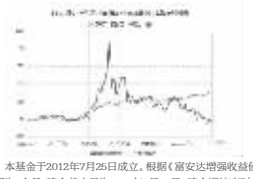
Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)

其中,t =1,2,3,…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



本基金于2012年7月25日成立。根据《富安达增强收益债券型证券投资基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2013年1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。



本基金于2012年7月25日成立。根据《富安达增强收益债券型证券投资基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2013年1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		
李飞	本基金的基金经理兼固定收益部副总监(主持工作),投资管理部总监助理(主持工作)	2013-07-04	-	14年	博士,历任上海技术应用技术学院财政经济系教师;紫阳数据有限责任公司研究发展中心项目经理;国盛证券有限责任公司投资研究部高级宏观债券研究员;金元惠理基金管理有限公司投资部基金经理。2012年5月加入富安达基金管理有限公司,2013年7月起任富安达增强收益债券型证券投资基金的基金经理,富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理(2013年10月25日至2016年10月25日期间)、富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理(2016年5月11日至2018年5月21日期间)。

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

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

四季度后中美贸易战触发了全球经济衰退的风险,原油价格过山车股大跌,海外投资者大幅抛售风险资产,追捧利率债等避险资产。美联储12月年内如期加息,但经济放缓的前景使得美国十年国债从3.25%一路下跌至2.70%,美国收益率曲线倒挂,表明预期未来衰退风险加大。国内宏观政策开始逐步转向,央行年内多次实施MLF等公开市场操作,年末资金总体平稳,长久期利率和高等级信用都受到追捧,收益率曲线长端明显下行,但短端随着中美利差的倒挂和央行连续36天停止公开市场净投放反而略有上行。维稳民企流动性纾困政策纷纷出台,股票交易监管政策也适度放松,科技创新板的推出以及中美在阿根廷达成90天贸易战停火和谈的举措也推动股票市场情绪在11月略微回暖,圣诞前夕,美国政府部分关闭,美股大跌,进入熊市,海外市场的调整也对年末国内市场带来压力,市场再次调整,上证50指数也跌破了盘整半年之久的箱体下沿。本基金主要持有大盘转债和信用债,因此表现并不尽如人意。

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0.9737元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-4.94%,同期业绩比较基准收益率为1.80%;截至报告期末富安达增强收益债券C基金份额净值为0.9479元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-5.03%,同期业绩比较基准收益率为1.80%。

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,本基金已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	8,604,946.00	13.81
	其中:股票	8,604,946.00	13.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,319,570.00	82.35
	其中:债券	51,319,570.00	82.35
	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	1,741,768.03	2.80
8	其他资产	650,876.34	1.04
9	合计	62,317,160.37	100.00

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	7,480,546.00	16.61
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	415,650.00	0.92
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	708,750.00	1.57
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	8,604,946.00	19.10

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

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	002048	宁波华翔	100,000	1,043,000.00	2.32
2	600810	神马股份	96,700	974,736.00	2.16
3	600585	海螺水泥	31,000	907,680.00	2.01
4	600622	光大嘉宝	125,000	708,750.00	1.57
5	000568	泸州老窖	15,300	622,098.00	1.38
6	600197	伊力特	45,000	586,350.00	1.30
7	300373	扬杰科技	38,000	548,720.00	1.22
8	000768	中航飞机	40,000	529,600.00	1.18
9	603713	密尔克卫	15,000	415,650.00	0.92
10	000830	鲁西化工	38,000	372,400.00	0.83

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	央行票据	-	-
3	金融债券	2,711,880.00	6.02
	其中:政策性金融债	2,711,880.00	6.02
4	企业债券	2,321,160.00	5.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	46,286,530.00	102.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,319,570.00	113.92

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	113013	国君转债	39,500	4,150,660.00	9.21
2	113011	光大转债	39,000	4,099,680.00	9.10
3	113009	广汽转债	40,050	4,056,664.50	9.01
4	128015	久其转债	43,100	4,003,128.00	8.89
5	128010	顺昌转债	34,520	3,353,618.00	7.44

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

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	13,445.59
2	应收证券清算款	341,046.70
3	应收股利	-
4	应收利息	295,583.86
5	应收申购款	800.19
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	650,876.34

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	113013	国君转债	4,150,660.00	9.21
2	113011	光大转债	4,099,680.00	9.10
3	113009	广汽转债	4,056,664.50	9.01
4	128015	久其转债	4,003,128.00	8.89
5	128010	顺昌转债	3,353,618.00	7.44
6	132013	17宝武EB	3,277,560.00	7.28
7	123007	道氏转债	3,243,708.00	7.20
8	123009	星源转债	2,954,940.80	6.56
9	110034	九州转债	2,841,806.80	6.31
10	132006	16皖新EB	2,048,200.00	4.55
11	128014	永东转债	1,839,616.20	4.08
12	132009	17中油EB	1,713,430.00	3.80
13	113503	泰晶转债	1,223,632.80	2.72
14	110033	国贸转债	1,032,900.00	2.29
15	113511	千禾转债	276,480.00	0.61

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

	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	18,893,233.71	27,620,864.91
报告期期间基金总申购份额	760,819.71	939,501.68
减:报告期期间基金总赎回份额	351,115.91	864,178.79
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	19,302,937.51	27,696,187.80

§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

	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	4,873,456.05
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00	4,873,456.05
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00	17.60

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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	20181001-20181231	13,807,758.52	-	-		13,807,758.52	29.38%
个人	1	20181001-20181231	10,029,526.94	-	-		10,029,526.94	21.34%
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。								

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2018年11月28日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海挖财基金销售有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告

2、2018年10月25日,富安达增强收益债券型证券投资基金2018年第三季度报告

§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)查阅。

富安达基金管理有限公司
2019年01月19日

富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

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01月19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1月17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2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达长盈灵活配置混合
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	21,560,110.24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PEO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,并据此进行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,债券、现金等资产之间的配置比例。
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(2018年10月01日 - 2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-774,917.36
2.本期利润	-1,404,007.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0616
4.期末基金资产净值	19,120,755.92
5.期末基金份额净值	0.887

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本基金于2018年5月19日成立。

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	-6.34%	0.94%	-6.22%	0.97%	-0.12%	-0.03%

①本基金业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×中债总指数,

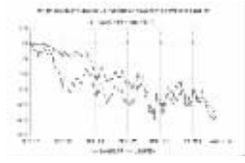
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =60%×[沪深300指数t /沪深300指数 (t-1)-1]+40%×[中债总指数t / 中债总指数(t-1)-1]

Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)

其中,t =1,2,3,…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



根据《富安达长盈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	-	15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。

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

市场在四季度仍有一定幅度的系统性下跌,本基金收益率为-6.34%,略跑赢基金基准。宏观经济层面,12月PMI数据显示经济增速下滑,虽然在货币政策上出现放松,但从宽流动性到宽信用尚需时间,我们预计短期内经济增速仍会继续向下。市场风险偏好随着一系列托底救市政策的出台以及中美贸易谈判的阶段性缓和出现一定的回升。我们在四季度权益类仓位主要配置在低估值金融、地产以及部分优质成长个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达长盈混合基金份额净值为0.887元,本报告期内,基金份额净值增长率为-6.34%,同期业绩比较基准收益率为-6.22%。

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,本基金已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	10,602,463.75	54.42
	其中:股票	10,602,463.75	54.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,052,611.20	5.40
	其中:债券	1,052,611.20	5.40
	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	7,535,393.29	38.68
8	其他资产	290,651.19	1.49
9	合计	19,481,119.43	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	163,406.80	0.85
B	采矿业	395,724.00	2.07
C	制造业	4,585,750.12	23.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	504,255.74	2.64
F	批发和零售业	205,071.60	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	57,285.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,173,619.25	6.14
J	金融业	1,276,617.62	6.68
K	房地产业	1,578,818.72	8.26
L	租赁和商务服务业	42,140.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	88,510.15	0.46
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	531,264.75	2.78
S	综合	-	-
	合计	10,602,463.75	55.45

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	600048	保利地产	42,023	495,451.17	2.59
2	002146	荣盛发展	51,562	409,917.90	2.14
3	300253	卫宁健康	32,834	409,111.64	2.14
4	000002	万 科A	13,900	331,098.00	1.73
5	601288	农业银行	91,947	331,009.20	1.73
6	002327	富安娜	41,076	308,480.76	1.61
7	601229	上海银行	24,929	278,955.51	1.46
8	603359	东珠生态	16,873	276,379.74	1.45
9	002624	完美世界	9,870	274,879.50	1.44
10	002152	广电运通	48,800	273,768.00	1.43

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	央行票据	-	-
3	金融债券	1,052,611.20	5.51
	其中:政策性金融债	1,052,611.20	5.51
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	1,052,611.20	5.51

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	018005	国开1701	10,480	1,052,611.20	5.51

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

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。

2018年1月4日,中国银行业监督管理委员会上海监管局依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项,作出沪银监罚决字(2018)1号行政处罚决定书,对上海银行责令改正,并处罚款人民币50万元。主要违法违规事实如下:2015年,该行对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎,部分理财资金用于增资和缴纳土地出让金,与合同约定用途不一致。

在本基金对该证券的投资过程中,本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下,经公司审慎研究评估,将该股票纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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	26,170.15
2	应收证券清算款	233,612.43
3	应收股利	-
4	应收利息	30,470.54
5	应收申购款	398.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	290,651.19

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	24,430,917.46
报告期期间基金总申购份额	45,746.89
减:报告期期间基金总赎回份额	2,916,554.13
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	21,560,110.24

§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,基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况,不存在利益冲突、显失公平的关联交易的情况。

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