

富安达增强收益债券型证券投资基金

2023年第4季度报告

2023年12月31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01月19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	13
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	13
§8 影响投资者决策的其他重要信息	13
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	13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	14
§9 备查文件目录	14
9.1 备查文件目录	14
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2023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	38,377,775.28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	20,075,520.42份	18,302,254.86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(2023年10月01日 - 2023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	10,833.75	-13,547.84
2.本期利润	134,446.42	93,733.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066	0.0051
4.期末基金资产净值	26,632,161.72	23,094,615.57
5.期末基金份额净值	1.3266	1.2618

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	0.52%	0.16%	0.58%	0.09%	-0.06%	0.07%
过去六个月	0.90%	0.16%	0.76%	0.09%	0.14%	0.07%
过去一年	2.23%	0.17%	3.03%	0.09%	-0.80%	0.08%
过去三年	-8.44%	0.99%	8.66%	0.13%	-17.10%	0.86%
过去五年	36.24%	1.10%	23.10%	0.13%	13.14%	0.97%
自基金合同生效起至今	35.26%	1.03%	60.88%	0.16%	-25.62%	0.87%

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	0.41%	0.16%	0.58%	0.09%	-0.17%	0.07%
过去六个月	0.69%	0.16%	0.76%	0.09%	-0.07%	0.07%
过去一年	1.82%	0.17%	3.03%	0.09%	-1.21%	0.08%
过去三年	-9.81%	0.99%	8.66%	0.13%	-18.47%	0.86%
过去五年	33.12%	1.10%	23.10%	0.13%	10.02%	0.97%
自基金合同生效起至今	28.66%	1.03%	60.88%	0.16%	-32.22%	0.87%

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-2023年12月31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-2023年12月31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	-	11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，2022年9月起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的基金经理。
赵恒毅	本基金的基金经理、固定收益部总监	2023-12-08	-	18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。2023年12月起任富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达增强收益债券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，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》中关于证券投资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

四季度，国内经济增长稳中趋缓。由于低基数效应，工业增加值、社会消费品零售总额、房地产开发投资同比数据均有所好转，但是制造业PMI逐月走弱显示增长动能趋缓。在此背景下，国内财政政策发力显著。国庆长假后，地方特殊再融资债券密集发行，助力地方化债。10月下旬财政部宣布增发万亿国债，将赤字率提高到3.8%。政府债券的增发导致商业银行资金紧张，货币市场和存单利率不断上行，中长端利率也被动抬升。11月末12月初，债券供给压力边际缓解，随后中央政治局会议定调偏稳健，国有大行再次下调存款利率，央行通过逆回购和MLF大量投放流动性，债券市场收益率陡峭化下行。四季度，股市总体表现不及预期，但仍存一定结构性机会。

报告期内，本基金适度提高了信用债的配置比例，主要标的为高等级中、短久期信用债，为基金提供了较稳定的基础收益。股票部分，本基金重点布局高分红和新兴行业，分散投资，仓位有所下降。转债部分，挑选高性价比品种，顺应市场风格，灵活操作，为基金业绩提供了一定的增强。

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1.3266元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.52%，同期业绩比较基准收益率为0.58%；截至报告期末富安达增强收益债券C基金份额净值为1.2618元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.41%，同期业绩比较基准收益率为0.58%。

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，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

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	3,039,447.25	5.20
	其中：股票	3,039,447.25	5.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,628,350.12	93.43
	其中：债券	54,628,350.12	93.43
	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	628,713.37	1.08
8	其他资产	174,827.46	0.30
9	合计	58,471,338.20	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	686,204.00	1.38
C	制造业	1,024,112.25	2.06
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	155,532.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	347,580.00	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	199,629.00	0.40
J	金融业	250,380.00	0.50

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	376,010.00	0.76
S	综合	-	-
	合计	3,039,447.25	6.11

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	600036	招商银行	9,000	250,380.00	0.50
2	601088	中国神华	7,700	241,395.00	0.49
3	601728	中国电信	36,900	199,629.00	0.40
4	600547	山东黄金	8,700	198,969.00	0.40
5	000429	粤高速 A	23,500	198,810.00	0.40
6	300413	芒果超媒	7,700	194,040.00	0.39
7	300133	华策影视	31,000	181,970.00	0.37
8	002415	海康威视	4,500	156,240.00	0.31
9	000034	神州数码	5,200	155,532.00	0.31
10	000933	神火股份	9,000	151,200.00	0.30

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	2,734,746.85	5.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,105,949.73	4.24
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	37,551,985.16	75.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,078,093.99	10.21
7	可转债（可交换债）	7,157,574.39	14.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,628,350.12	109.86

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	1480164	14鄂交投01	30,000	3,181,749.18	6.40
2	188115	21诚通07	30,000	3,065,458.85	6.16
3	155693	19航控08	30,000	3,055,161.04	6.14
4	102282389	22鄂联投MTN004	30,000	3,047,357.38	6.13
5	143167	17光控02	25,000	2,531,308.22	5.09

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	15,654.94
2	应收证券清算款	155,671.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,501.12
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	174,827.46

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	113044	大秦转债	650,290.37	1.31
2	127012	招路转债	445,710.73	0.90
3	110088	淮22转债	303,622.68	0.61
4	110045	海澜转债	293,100.77	0.59
5	127078	优彩转债	253,930.68	0.51
6	110079	杭银转债	252,239.86	0.51
7	128141	旺能转债	251,943.15	0.51
8	113637	华翔转债	247,598.71	0.50
9	113066	平煤转债	247,569.54	0.50
10	127049	希望转2	247,487.74	0.50
11	118026	利元转债	247,244.32	0.50
12	127020	中金转债	246,312.70	0.50
13	123071	天能转债	205,170.21	0.41

14	127079	华亚转债	199,256.28	0.40
15	123171	共同转债	198,530.51	0.40
16	123190	道氏转02	198,330.00	0.40
17	123158	宙邦转债	198,129.34	0.40
18	127063	贵轮转债	152,505.02	0.31
19	113662	豪能转债	151,892.97	0.31
20	118011	银微转债	148,388.35	0.30
21	110048	福能转债	98,344.73	0.20

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	20,487,316.58	18,640,188.91
报告期期间基金总申购份额	119,513.29	57,181.83
减：报告期期间基金总赎回份额	531,309.45	395,115.88
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	20,075,520.42	18,302,254.86

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	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	持有基金份额比	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

者类别	号	例达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20231001-20231231	20,623,543.25	0.00	0.00	20,623,543.25	53.74%
产品特有風險							
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. 2023年10月24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
2. 2023年10月24日，富安达增强收益债券型证券投资基金2023年第3季度报告
3. 2023年10月30日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加长城证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告
4. 2023年11月29日，富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告
5. 2023年11月30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
6. 2023年12月2日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加麦高证券有限责任公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告
7. 2023年12月9日，富安达增强收益债券型证券投资基金基金经理变更公告
8. 2023年12月13日，富安达增强收益债券型证券投资基金更新招募说明书（更新）（二〇二三年第二号）
9. 2023年12月13日，富安达增强收益债券型证券投资基金基金产品资料概要更新
10. 2023年12月27日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海陆亨基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告
11. 2023年12月28日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告

§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）查阅。

富安达基金管理有限公司

2024年01月19日