富安达增强收益债券型证券投资基金

2012年度报告摘要

2012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
送出日期:2013年03月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2013年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2012年7月25日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达增强收益债券型证券投资基金	
基金简称	富安达增强收益债券	
基金主代码	710301	
交易代码		
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	
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	
报告期末基金份额总额	237,541,996.52份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所		
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	127,639,237.02份	109,902,759.50份

2.2 基金产品说明

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,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。本基金通过久期配置、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。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋晓刚	裴学敏
	联系电话	021-61870999	021-32169999
	电子邮箱	service@fadfunds.com	zh_jjf@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999 免长途 021-61870666	95559
传真		021-61870888	021-62701262
注册地址		上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	上海市仙霞路18号
邮政编码		200122	200120
法定代表人		张华东	胡怀邦

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2012年
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
本期已实现收益	1,122,856.44	1,208,037.72
本期利润	2,082,284.11	1,999,588.76
加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0077
本期基金加权平均净值利润率	1.18%	0.77%
本期基金份额净值增长率	1.40%	1.21%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2012年末
期末可供分配利润	860,507.36	535,958.92
期末可供分配基金份额利润	0.0067	0.0049
期末基金资产净值	129,423,822.96	111,233,085.17
期末基金份额净值	1.0140	1.0121
3.1.3 累计期末指标	2012年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	1.40%	1.21%

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,例如:基金的认购、申购、赎回费等,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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金于2012年7月25日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

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

阶段 (富安达增强收益债券A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.10%	0.06%	1.51%	0.13%	-0.41%	-0.07%
自基金合同生效日起至今(2012年07月25日-2012年12月31日)	1.40%	0.04%	0.49%	0.13%	0.91%	-0.09%

注: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。

阶段 (富安达增强收益债券C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.99%	0.06%	1.51%	0.13%	-0.52%	-0.07%
自基金合同生效日起至今(2012年07月25日-2012年12月31日)	1.21%	0.04%	0.49%	0.13%	0.72%	-0.09%

注: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,

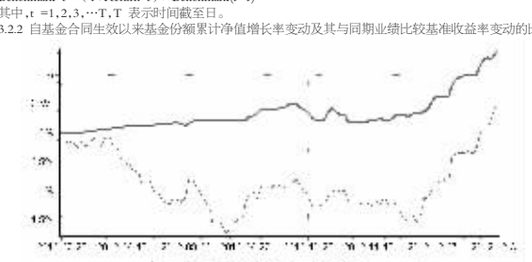
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

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]

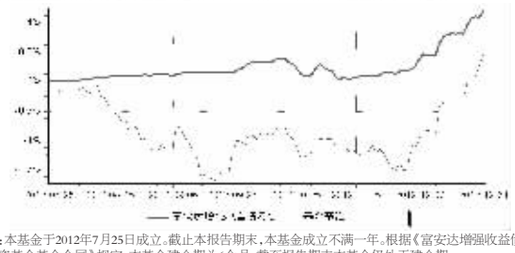
Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)

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份额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

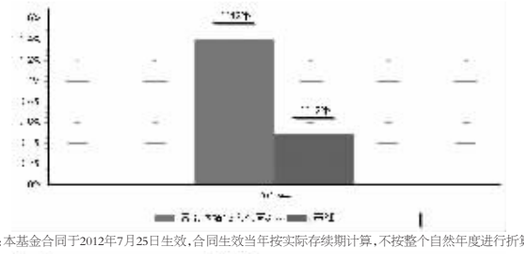


注:本基金于2012年7月25日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。根据《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末本基金仍处于建仓期。

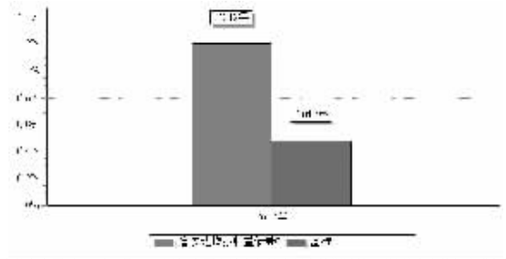


注:本基金于2012年7月25日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。根据《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,截至报告期末本基金仍处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2012年7月25日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。



注:本基金合同于2012年7月25日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司三家单位共同发起设立。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦,注册资本2.88亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念,以基金持有人利益最大化为首要经营目标,为客户提供卓越的理财服务。

截至2012年12月31日,公司共管理三只开放式基金:富安达优势成长股票型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄强先生	本基金的基金经理、研究发展部副总监	2012年07月25日	-	19年	经济学硕士,历任浙江财政证券公司投资经理、光大证券资产管理部投资经理、助理总经理、泰信基金高级经理、光大保德信基金公司基金经理助理、首席策略分析师,现任富安达基金管理有限公司研究发展部副总监,投资决策委员会成员。

注:1、任职日期和离任日期均指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,任职日期为基金合同生效日。

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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起,监察稽核部分季度对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,发现在各个计算周期内,1日、3日、5日和30日时间窗的同向交易样本数量均少于30个,不满足T检验所需的样本个数,并通过对各投资组合间以及单个组合与组合类别间的公平交易结果分析,在特定时间窗内交易证券的溢价率和溢价金额均在正常范围内,因此不构成潜在利益输送的显著性。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立于7月下旬,恰逢跨年度债市行情已连续涨了九个月,品种轮动完全演绎,基本符合美林时钟理论。基准利率明显下行,十年期国债从2011年8月底的4.13%下降到了7月底的3.25%;AA-中票的信用利差也缩减了120bp。并且央行采取逆回购操作延迟降准,客观上造成资金利率高企。而政府稳增长政策的紧密出台将使得经济在三季度企稳,四季度反弹,总体对债市构成不利。因此本基金采取缓建仓策略,投资品种主要以定存为主。而债市在7-8月短期调整后,信用利差出现了较大程度的上行。本基金在封闭期打开后快速建仓,利用债市反弹良机不断优化债券的持仓结构,将久期控制在中性水平,保持一定的杠杆率,主要投向是信用债,并对对转债进行了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,富安达增强收益债券A基金份额净值为1.0140元,本报告期净值增长率为1.4%;富安达增强收益债券C基金份额净值为1.0121元本报告期净值增长率为1.21%,同期业绩比较基准增长率为0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新年伊始,市场充裕的流动性和对新一届中央政府新政的良好预期造成了债券和股票都出现了上涨。我们认为宏观经济在2013年将温和复苏,通胀压力有所上升,但总体可控。2013年央行将实施短期流动性调节工具平抑资金价格,引导降低实体经济的融资成本,回购利率有望保持平稳。在短端利率已经下行较多的情况下,上半年中票和中等期限的企业债是较好的投资品种。

本基金将秉承富安达基金"理性分析价值、深度挖掘增长"的投资理念,坚持规范运作,审慎投资,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设,强化内部管理,不断提升自身合规风控能力。报告期内,公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程,强化内控基础建设;牵头开展了多形式的合规培训,强化员工职业道德教育和合规意识培育,从源头上防范合规风险;建立健全防控内幕交易机制,确保基金投资的独立性、公平性和合规性;加强业务日常合规审核和合规监测,并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查,确保各项法规和管理制度有效落实,使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规,有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,建立健全全面风险管理体系,不断提高监察稽核工作的科学性和有效性,最大限度地防范和化解经营风险,充分保护基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,公司总经理担任估值委员会主席,研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期未进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年度,基金托管人在富安达增强收益债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年度,富安达基金管理有限公司在富安达增强收益债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2012年度,由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达增强收益债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第21066号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富安达增强收益债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富安达增强收益债券型证券投资基金(以下简称"富安达增强收益基金")的财务报表,包括2012年12月31日的资产负债表、2012年7月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是 富安达增强收益基金 的基金管理人 富安达基金管理有限公司 管理层的责任,这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述富安达增强收益基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了富安达增强收益基金2012年12月31日的财务状况以及2012年7月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	
单峰、张晓艺	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
审计报告日期	2012-03-26

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:富安达增强收益债券型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	7.4.7.1	1,452,629.22
结算备付金		1,368,124.50
存出保证金		13.87
交易性金融资产	7.4.7.2	343,813,312.88
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		343,813,312.88
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	10,000,000.00
应收证券清算款		5,634,303.82
应收利息	7.4.7.5	2,188,575.30
应收股利		-
应收申购款		1,395.05
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		364,458,354.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		118,439,705.60
应付证券清算款		669,433.86
应付赎回款		4,037,846.48
应付管理人报酬		155,092.44
应付托管费		44,312.14
应付销售服务费		42,334.48
应付交易费用	7.4.7.7	27,951.31
应交税费		56,960.00
应付利息		147,257.89
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	180,552.31
负债合计		123,801,446.51
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	237,541,996.52
未分配利润	7.4.7.10	3,114,911.61
所有者权益合计		240,656,908.13
负债和所有者权益总计		364,458,354.64

注:1、报告截止日2012年12月31日,富安达增强收益A类基金份额净值1.0140元,富安达增强收益C类基金份额净值1.0121元;富安达增强收益基金份额总额237,541,996.52份(其中A类127,639,237.02份,C类109,902,759.50份)。

2、本基金合同于2012年7月25日生效,本财务报表的实际编制期间为2012年7月25日至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:富安达增强收益债券型证券投资基金

本报告期:2012年07月25日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年07月25日至2012年12月31日
一、收入		6,817,068.16
1.利息收入		5,845,879.68
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,103,112.64
债券利息收入		1,662,661.38
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,080,105.66
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-799,197.22
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-810,655.21
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	11,457.99
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	1,750,978.71
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	19,406.99
减:二、费用		2,735,195.29
1.管理人报酬		1,316,148.96
2.托管费		376,042.56
3.销售服务费		446,449.58
4.交易费用	7.4.7.18	43,638.79
5.利息支出		303,322.56
其中:卖出回购金融资产支出		303,322.56
6.其他费用	7.4.7.19	249,592.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		4,081,872.87
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		4,081,872.87

注:本基金合同于2012年7月25日生效,本期数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富安达增强收益债券型证券投资基金

本报告期:2012年07月25日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年07月25日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	606,269,167.85	-	606,269,167.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		4,081,872.87	4,081,872.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-368,727,171.33	-966,961.26	-369,694,132.59
其中:1.基金申购款	10,155,855.77	16,709.33	10,172,565.10
2.基金赎回款	-378,883,027.10	-983,670.59	-379,866,697.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	237,541,996.52	3,114,911.61	240,656,908.13

注:本基金合同于2012年7月25日生效,本期数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

李剑锋	蒋晓刚	袁欣
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司("南京证券")	基金管理人的控股股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司("江苏交通")	基金管理人的股东
南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司("南京河西")	基金管理人的股东

注:1、南京证券有限责任公司于2012年9月21日发布公告,经中国证监会证监许可【2012】1217号文核准批复,其公司名称变更为"南京证券股份有限公司"。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付给关联方的佣金。

7.4.4.1.4 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年07月25日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,316,148.96
其中:支付销售机构的客户维护费	717,141.95

注:1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 ×0.7% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

3、本基金合同于2012年7月25日生效,本期数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年07月25日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	376,042.56

注:1.支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

2、本基金合同于2012年7月25日生效,本期数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2012年07月25日至2012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	合计
富安达基金管理有限公司	-	16,030.24	16,030.24
交通银行股份有限公司	-	378,868.09	378,868.09
南京证券股份有限公司	-	15,458.62	15,458.62
合计		410,356.95	410,356.95

注:1.支付基金销售机构的增强收益C类销售服务费按前一日增强收益C类基金资产净值0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给富安达基金,再由富安达基金计算并支付给各基金销售机构。增强收益A类不收取销售服务费。其计算公式为:日销售服务费=前一日增强收益C类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

2、本基金合同于2012年7月25日生效,本期数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告内未与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年07月25日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	1,452,629.22	112,788.81
交通银行定期存款	-	155,555.56

注:1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2012年12月31日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金2012年7月25日(基金合同生效日)至2012年12月31日期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.5 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
112130	12华包债	2012-11-28	2013-01-09	新发流通受限	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00
112141	12金王债	2012-12-21	2013-02-04	新发流通受限	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1282490	12川投标MTN1	2013-01-07	99.98	200,000	19,996,000.00
1282429	12广汇MTN2	2013-01-07	100.18	200,000	20,036,000.00
合计				400,000	40,032,000.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额82,439,959.60元(共7笔),于2013年1月4日(4笔)、2013年1月17日(1笔)、2013年1月28日(1笔)、2013年3月21日(1笔)先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	343,813,312.88	94.34
	其中:债券	343,813,312.88	94.34
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	10,000,000.00	2.74
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,820,753.72	0.77
6	其他各项资产	7,824,288.04	2.15
7	合计	364,458,354.64	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600252	中恒集团	3,978,362.00	1.65
2	002065	东华软件	3,683,275.00	1.53
3	600690	青岛海尔	1,687,480.27	0.70
4	002081	金 螳 螂	1,284,640.00	0.53
5	000858	五 粮 液	1,046,500.00	0.43
6	601669	中国水电	780,980.00	0.32
7	000718	苏宁环球	704,514.00	0.29
8	601886	江河幕墙	468,000.00	0.19
9	002700	新疆浩源	10,865.00	-
10	300353	东土科技	10,375.00	-
11	603993	洛阳钼业	3,000.00	-

注:1、"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

2、本基金于2012年7月25日成立,"期初基金资产净值"相应调整为"期末基金资产净值"。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600252	中恒集团	3,782,433.05	1.57
2	002065	东华软件	3,205,510.90	1.33
3	600690	青岛海尔	1,683,231.09	0.70
4	002081	金 螳 螂	1,228,500.00	0.51
5	000858	五 粮 液	995,351.00	0.41
6	601669	中国水电	755,713.00	0.31
7	000718	苏宁环球	672,718.00	0.28
8	601886	江河幕墙	488,929.02	0.20
9	002700	新疆浩源	15,450.00	0.01
10	300353	东土科技	10,500.00	-
11	603993	洛