富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

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 3 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 4 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	富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	富安达策略精选混合
基金主代码	710002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 4 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	168,612,550.24
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧跟中国经济发展趋势,在充分控制风险的前提下,通过投资具有持续增长潜力且具有合理估值的上市公司,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要采用自下而上的个股精选策略,通过 GARP 策略精选具有成长潜力和合理估值的上市公司,在此基础上结合研究团队的定性分析及实地调研,动态调整本基金的投资组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,属于较高风险、较高收益产品。一般情况,其风险和收益高于债券型基金和货币市场基金。

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	裘学敏
	联系电话	021-61870999	021-32169999
	电子邮箱	service@fadfunds.com	zh_jjb@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 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-22,957,256.20
本期利润	-11,396,052.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0379
本期加权平均净值利润率	-3.89%
本期基金份额净值增长率	-2.01%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配利润	-17,260,677.13
期末可供分配基金份额利润	-0.1024
期末基金资产净值	165,220,104.75
期末基金份额净值	0.9799
3.1.3 累计期末指标	2012年末
基金份额累计净值增长率	-2.01%

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 4 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	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	3.26%	0.80%	5.87%	0.70%	-2.61%	0.10%
过去六个月	-0.64%	0.75%	2.31%	0.68%	-2.95%	0.07%
自基金合同生效日起至今(2012 年 04 月 25 日-2012 年 12 月 31 日)	-2.01%	0.65%	-0.43%	0.66%	-1.58%	-0.01%

注:①本基金业绩比较基准为:55%×沪深 300 指数+45%×上证国债指数。

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 =55%×[沪深 300 指数 t / 沪深 300 指数(t-1)-1]+45%×[上证国债指数 t / 上证国债指数(t-1) -1]

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

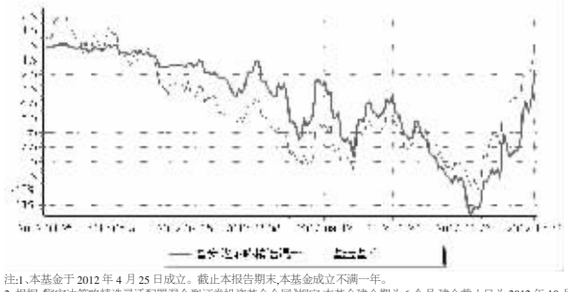
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

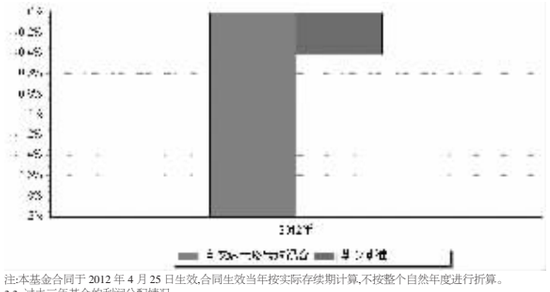
(2012 年 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日)



注:1、本基金于 2012 年 4 月 25 日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2、根据《富安达策略精选灵活配置混合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 2012 年 10 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。

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 4 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 4 月 25 日	-	19年	经济学硕士。19 年证券投资研究从业经验,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、《富安达策略精选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。

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》。

从基金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

本报告期内,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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期是基金成立的第一个年头,虽然没有完整年度的操作时间段,但仍旧有很多值得总结的经验和心得。报告期内,本基金净值增长率为-2.01%,业绩比较基准增长率为-0.43%,跑输业绩基准 1.58%,主要是在四季度的行情中未能及时切换基金风格,丧失了超额正收益。

本基金成立于四月底,正逢五一假期后的三天是年度行情的高点,基于当时被政策红利所刺激,对行情趋势的判断出现了一些失误,虽然也配置了一些医药板块,但错误配置了一些周期性行业,而对于表现优异的 TMT 子行业未给予重视。在封闭期和建仓期内,虽然总体跌幅不大,但仍不甚理想,主要是先在行业配置上出现偏差,之后在八月末作左侧的择时策略下尽管行业配置正确,但未能坚持到最后。市场在四季度其实有逐步见底的迹象,监管部门对市场的呵护和维护政策屡屡出手,但在前期由于对经济回升缺乏信心以及对经济前景的悲观,市场始终未能摆脱弱市。在十八大以后,新领导集体旗帜鲜明地提出了改革的纲领,且实行了不少新的规范,给予了市场信心,加上 5 月份以来,加大基建投入的效果在四季度逐步开始显现,经济数据也呈现回升态势,积弱已久的市场终于爆发,在 12 月迎来久所未见的上涨,低估值周期板块的预期改善相当明显,涨幅可观。从操作过程来看,本基金在三季度依靠医药股为主获取收益之后未及时兑现,对低估值板块的配置不够未雨绸缪及时切换风格。在 12 月新政行情来临之初,本基金整体上加仓较为及时,主要配置在银行、金融、地产等低估值和早周期板块,但因仓位较低,在一定程度上影响了整体业绩,12 月份本基金只跑平业绩基准,未能完全弥补之前的负收益。2013 年我们会认真总结经验教训,希望做得更好!

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 0.9799 元,本报告期份额净值增长率为-2.01%,同期业绩比较基准收益率为-0.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013 年的市场格局,我们短期仍旧谨慎乐观,认为市场即使有波动,但仍具备可操作性和操作价值,中期略偏谨慎一点,主要基于我们对政策力度、改革方向、增长与转型的各自追求都无法过早作出明确判断,我们在年度策略报告已经提到,今年的行情是迎风启航,见风使舵,政策和改革决定市场未来的基本价值中枢所在,所以我们的确没必要也没有能力对政策变化过早的下绝对性的结论,我们只能密切关注,紧密跟随。当然,如果一切都向好的方向发展,也就是有利于资本市场长期健康发展,有利于推进企业自主创新,推进国民经济向更有质量的增长发展,那么对后市可以更乐观一些,但是管理人内心深处始终觉得这不是一件容易的事,是需要从社会道德,价值取向,商业精神等诸多深层次因素着手才能渐渐取得成效的事情。

春节后市场上绝大部分卖方齐声喊涨,观点惊人的雷同,而卖方的一致预期与实际情况的背离再次被市场验证,市场出现一次明显波动,如果我们希望比其他人看清更多的未来,则仍需坚定观察决定市场走向的几个大方面。

从经济层面看,弱复苏的结论以为大部分人所接受,在弱复苏的大前提下,产能明显过剩的产业,短期难以从需求增长中受益,所以很多价格敏感型的中上游行业我们并不看好,因为只要供给端的调整没有完成的话,这些敏感型行业的价格上涨都是脆弱的不可持续的。当然,在库存周期的作用下,部分库存较低的行业间或会出现补库存的迹象,一定时期内能够拉动了产品价格的上涨,有利于产业链中企业恢复盈利能力,可能带来一些投资机会。长期而言,随着我国国内重工业化进入后期,人力成本逐渐上升,潜在经济增长中枢将逐渐下移,由过去 10 年 9-10%的水平下降至 7-8%;虽然增速下降,但若政策得当,经济增速的波动将减小,增长将更趋健康稳健。更大视野来说,管理人始终觉得在发达经济体来说,美国经济增长将一枝独秀,所以美元在 2013 年应该相对稳健甚至相对强健,所以 CRB 指数不具备较大时间和空间的走高机会,对商品价格不利,而国内基础设施原料行业也受限于边际增长下行的现实,没有特别大的机会,在经济转型的大背景下,我们还是偏好技术密集型的产业更有望在复苏中率先迎来盈利能力的显著提升,因为他们滞动的是社会的需求升级和产业转型,需求空间和增长空间都更大。

从流动性来说,仅以央行节后的动作来看,可以判断未来新一届政府不太会继续采用放松货币来刺激的做法,政策基调应该是中性偏谨慎,房价对货币政策的制约是显而易见的,一旦拿捏不好,更容易引发通胀在下半年明显上升,所以央行总体仍旧是在钢丝上行走,不宜过分乐观。而在资本市场本身,我们相信未来的融资开闸是必然的事情,股票供给将增加,未来估值分化难免。

对于证券市场,我们认为经过 2012 年底的估值修复,市场人气、成交量都有所恢复,而一季度的宏观数据相对平淡,对验证经济增长趋势的作用不大,因此预计市场对经济复苏的预期仍将延续,但市场估值水平继续提升的空间不大,不过短期内我们认为指数向下的空间也不会很大。后期的行情发展取决于各行业的盈利恢复情况,需要宏观、微观数据以及企业财报的综合验证。固定收益市场方面,目前收益率水平处于较低位置,预计将受到通胀回升的影响逐渐上行,此外政府对影子银行的清理也可能导致阶段性的流动性紧张进而影响固定收益市场。对此,基金管理人将以更加严谨的心态、更加细致的研究分析,规范运作、审慎投资,努力为持有人获取长期回报。总体上,我们在 2013 年上半年将采取跟随策略,因为基金规模不大,可以操作的灵活一些,重点配置的行业板块预计会是医药,基础消费,环保,银行,金融,消费电子以及成长股。

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策略精选灵活配置混合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策略精选灵活配置混合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策略精选灵活配置混合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 21065 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	富安达策略精选灵活配置混合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策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"富安达策略精选基金")的财务报表,包括:2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年 4 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 富安达策略精选基金 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")规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,上述富安达策略精选基金 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 富安达策略精选基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间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	2013-03-26

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

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	6,907,312.46
结算备付金		17,946,602.65
存出保证金		100,346.88
交易性金融资产	7.4.7.2	153,244,482.36
其中:股票投资		123,208,482.36
基金投资		-
债券投资		30,036,000.00
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	434,749.70
应收股利		-
应收申购款		891.39
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		178,634,385.44
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		-
应付证券清算款		10,724,924.05
应付赎回款		1,973,657.18
应付管理人报酬		204,012.14
应付托管费		34,002.02
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	310,246.93
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	167,438.37
负债合计		13,414,280.69
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	168,612,550.24
未分配利润	7.4.7.10	-3,392,445.49
所有者权益合计		165,220,104.75
负债和所有者权益总计		178,634,385.44

注:1、报告截止日 2012 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.9799 元,基金份额总额 168,612,550.24 份。

2、本基金合同于 2012 年 4 月 25 日生效,本财务报表的实际编制期间为 2012 年 4 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体:富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012 年 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2012年 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日
一、收入		-6,291,215.39
1.利息收入		3,875,174.64
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,856,559.30
债券利息收入		423,361.78
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,595,253.56
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-22,236,506.95
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-23,116,516.06
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	78,320.40
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	801,688.71
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	11,561,204.18
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	508,912.74
减:二、费用		5,104,836.63
1.管理人报酬		3,005,759.00
2.托管费		500,959.84
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.18	1,219,455.81
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.4.7.19	378,661.98
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-11,396,052.02
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-11,396,052.02

注:本基金合同于 2012 年 4 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:富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012 年 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年 4 月 25 日-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)	583,363,852.64	-	583,363,852.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,396,052.02	-11,396,052.02
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)	-414,751,302.40	8,003,606.53	-406,747,695.87
其中:1.基金申购款	399,596.22	-20,441.28	379,154.94
2.基金赎回款	-415,150,898.62	8,024,047.81	-407,126,850.81
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)	168,612,550.24	-3,392,445.49	165,220,104.75

注:本基金合同于 2012 年 4 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 债券交易

注:本基金合同于 2012 年 4 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。

7.4.4.1.4 债券回购交易

注: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 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,005,759.00
其中:支付销售机构的客户维护费	1,008,860.49

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 1.5%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 × 1.5% / 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 4 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 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	500,959.84

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 0.25%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 × 0.25% / 当年天数。

2、本基金合同于 2012 年 4 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

份额单位:人民币元

项目	本期 2012年 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2012 年 4 月 25 日)持有的基金份额	9,999,000.00
期初持有的基金份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
期末持有的基金份额	9,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.93%

注:本基金管理人于本期通过代销机构认购本基金,认购手续费 1000 元。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南京证券	6,899,000.00	4.09%

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 4 月 25 日-2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	6,907,312.46	352,921.80
交通银行定期存款	-	685,000.00

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 4 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。

7.4.5 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
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

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
000002	万科 A	2012-12-26	重大事项	10.12	2013-01-21	11.13	300,000	2,875,600.00	3,036,000.00

注:无

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

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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	123,208,482.36	68.97
	其中:股票	123,208,482.36	68.97
2	固定收益投资	30,036,000.00	16.81
	其中:债券	30,036,000.00	16.81
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	24,853,915.11	13.91
6	其他各项资产	535,987.97	0.30
7	合计	178,634,385.44	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	11,053,900.00	6.69
C	制造业	27,698,050.00	16.76
C0	食品、饮料	4,396,000.00	2.66
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3