富安达现金通货币市场证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:2013年10月23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2013年10月22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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达现金通货币	
基金主代码	710501	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年01月29日	
报告期末基金份额总额	123,487,280.22份	
投资目标	本基金将在保持基金资产安全性和高流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	本基金管理人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,通过对宏观经济指标的分析,包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等,对短期利率走势进行综合判断,并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。在预期市场利率水平将上升时,适度缩短投资组合的平均剩余期限;在预期市场利率水平将下降时,适度延长投资组合的平均剩余期限。	
业绩比较基准	同期活期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,属于低风险产品。一般情况,其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	富安达现金通货币A	富安达现金通货币B
下属两级基金的交易代码	710501	710502
报告期末下属两级基金的份额总额	23,543,978.51	99,943,301.71

§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(2013年07月01日-2013年09月30日)	
	富安达现金通货币A	富安达现金通货币B
1.本期已实现收益	331,080.59	927,196.30
2.本期利润	331,080.59	927,196.30
3.期末基金资产净值	23,543,978.51	99,943,301.71

注:①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。由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

②基金于2013年1月29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 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

1.富安达现金通货币A

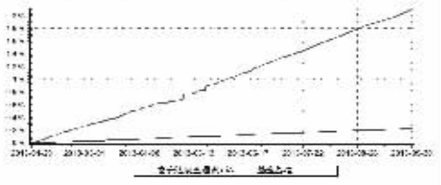
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8276%	0.0017%	0.0883%	0.0000%	0.7393%	0.0017%

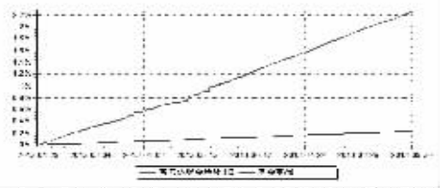
2.富安达现金通货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8891%	0.0017%	0.0883%	0.0000%	0.8008%	0.0017%

注:本基金收益分配按月结转为份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2013年1月29日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。根据《富安达现金通货币市场证券基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2013年7月28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		
张凯瑜	本基金的基金经理	2013年01月29日	—	6年	硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍,历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理师;爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员。

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 投资期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《富安达现金通货币市场证券投资基金合同》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》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起,监察稽核部定期对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日、5日和10日时间窗分析同向交易中在价格差异的样本。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。

4.3.2 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 投资期内基金的投资策略和运作分析

本基金在三季度的操作不尽如人意,虽然取得正收益,但与市场领先基金的收益率差距被拉开。截止季度末,本基金季度净值增长率为12.68%,业绩基准收益率为5.46%,超额收益为7.22%。

回顾三季度,管理人虽然在五月底已经意识到行情有向科技股行情演化的趋势和倾向,但对于网络传媒股的认识还是不够,一季度本基金已介入传媒股龙头品种,但在二季度传媒股进入高估值区域后就进行了获利了结,完全没有意识到这是一次网络传媒股的"市梦率"行情。在季度初,本基金仍持有一定仓位的电力设备和地产板块,在7月进行了调整,整体配置更加偏向了TMT、医药、消费、环保,TMT主要集中在电子和计算机,但传媒板块配置不足,所以导致在互联网和传媒大行情中落后市场优秀基金。9月,本基金略增加了对传媒板块的交易性投资,在三季度末,加大了对通信板块的配置,目前的配置结构仍旧以通信、电子、计算机、医药、传媒、消费为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为1.1366元,本报告期份额净值增长率为12.68%,同期业绩比较基准增长率为5.46%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年四季度,我们对四季度的宏观经济依然持相对谨慎的看法。尽管三季度经济表现出弱复苏的态势,但从近期的景气调查和微观数据来看,经济增速再提升的空间不大,弱反弹已近尾声。四季度整体而言,预计经济增长将维持在相对不高、但可接受的水平上;金社会意义上的就业率仍然保持良好,物价水平虽然可能小幅上扬,但总体基本维持稳定;地方融资平台及金融系统继续今年以来的风险排查工作,流动性处在相对中性的环境中。从行业的角度看景气分化仍会继续,很多产能过剩的传统行业仍在去产能的过程中,盈利水平维持低位或呈下降趋势,部分消费相关的行业或新兴产业仍将维持较好的增长水平。外围方面,美联储决定暂不削减QE,流动性宽松的低利率环境得以延续,消除了新兴市场的部分短期风险,但中长期来看资金回流美国的趋势仍在,我国的外汇占款情况也很难出现系统性的改善;此外,美国政府关门、债务上限到期也导致市场预期波动,外围市场仍处于多事之秋。

市场方面,宏观大环境及行业的分化反映到市场上就表现为传统行业和新兴成长行业相关板块的估值分化,前者估值较低、基本面也有一些硬伤,后者估值较高、可能透支未来的增长;短期来看,除非有流动性的支撑或行业基本面的不确定性消除,传统行业很难形成持续上涨的趋势;受益于改革红利预期的行业仍是市场主线;长期来看,新兴产业相关的板块也会经历一个去伪存真的过程,需要经过业绩检验,需要我们从个体公司的竞争力出发、寻找优质公司进行投资。对于IPO开闸,我们改变之前的乐观看法,基于目前中小盘股票的估值水平,我们认为中小板和创业板的新股发行将在一个较高的估值水平上重启,如此以来,投资价值和机会将大大减少,还可能由于定价过高引发未来的价值回归,所以我们将谨慎对待之!尽管市场、经济都处于不断变化中,基金管理人仍将以不变的严谨心态、细致研究、在控制风险的前提下积极主动的寻找中长期的结构性投资机会,争取为投资者获取长期、稳定的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产的比例(%)
1	固定收益投资	39,946,972.90	32.26
	其中:债券	39,946,972.90	32.26
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	47,700,391.55	38.52
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	35,673,339.82	28.80
4	其他资产	526,036.25	0.42
5	合计	123,846,740.52	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 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.47	
	其中:买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中:买断式回购融资	—	—

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内,不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	73
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金的基金合同规定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过120天。下同。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	83.67	—
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.09	—
2	30天(含)—60天	—	—
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	—	—
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—180天	—	—
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天(含)	16.20	—
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		99.87	—

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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	19,946,106.71	16.15
	其中:政策性金融债	19,946,106.71	16.15
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	20,000,866.19	16.20
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	39,946,972.90	32.35
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,993,366.86	8.09

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041356017	13天山水泥CP002	100,000	10,000,591.02	8.10
2	041361030	13粤佛塑CP001	100,000	10,000,275.17	8.10
3	120233	12国开33	100,000	9,993,366.86	8.09
4	130232	13国开32	100,000	9,952,739.85	8.06

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	1
报告期内偏离度的最高值	-0.0274%
报告期内偏离度的最低值	-0.2658%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1457%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

本基金采用1.00固定单位净值交易方式,自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金持有人,并按月结转到投资人基金账户。

5.8.2 报告期内,本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3 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。

5.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	526,036.25
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	其他	—
7	合计	526,036.25

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	富安达现金通货币A	富安达现金通货币B
本报告期期初基金份额总额	43,678,990.56	73,725,188.86
本报告期基金总申购份额	54,507,692.64	149,509,363.77
减:本报告期基金总赎回份额	74,642,704.69	123,291,250.92
本报告期期末基金份额总额	23,543,978.51	99,943,301.71

注:①报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入机分级份额调增份额;总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

②本基金于2013年1月29日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金投资本基金的情况。

本报告期内,基金管理人的子公司富安达资产管理(上海)有限公司运用固有资金投资本基金的情况如下:

2013年8月23日,富安达资产管理(上海)有限公司赎回富安达现金通货币基金B类100万份,赎回费率为0%;2013年9月10日富安达资产管理(上海)有限公司申购富安达现金通货币基金B类200万份,申购费率为0%。上述交易的申购赎回费率与其他基金投资人相同,交易符合法律法规规定,不存在利益冲突和显失公平的关联交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013/07/17 富安达现金通货币市场证券投资基金2013年第2季度报告

2013/08/29 富安达现金通货币市场证券投资基金2013年半年度报告

2013/09/11 富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书(更新)

2013/09/11 富安达货币市场现金通证券投资基金招募说明书(更新)摘要

2013/09/13 关于富安达现金通货币市场证券投资基金2013年中秋节及国庆节前暂停申购(含定投及转换转入)业务的公告

2013/09/26 关于增加万银财富(北京)基金销售有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构及开通开放式基金非现场交易方式办理申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

《富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书》

《富安达现金通货币市场证券投资基金基金合同》

《富安达现金通货币市场证券投资基金托管协议》

《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》

基金管理人业务资格批件和营业执照

基金托管人业务资格批件和营业执照

基金托管人业务资格批件和营业执照

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

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
二〇一三年十月二十三日

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:2013年10月23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2013年10月22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2013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
报告期末基金份额总额	52,413,031.22份
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	本基金主要采用目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。
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

§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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	3,320,180.31
2.本期利润	8,610,487.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.1413
4.期末基金资产净值	59,570,603.91
5.期末基金份额净值	1.1366

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。

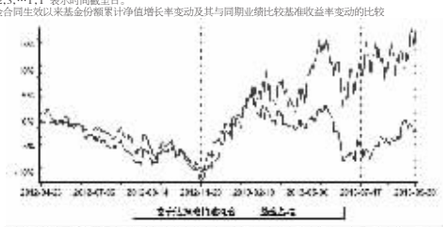
3.2 基金净值表现

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

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:根据《富安达策略精选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。截止报告期末,本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券低于5%,已在规定时间内完成调整。

§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		
黄强	本基金的基金经理、公司研究发展部副总监	2012年4月25日	—	19年	硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍,历任浙江财政证券公司投资二部投资经理、光大证券有限公司资产管理部投资经理、助理总经理、研究所策略分析师、泰信基金管理有限公司投资理财部高级投资经理、中信基金管理有限公司上海分公司高级经理、副总裁、光大保德信基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、首席策略分析师。

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、《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金合同》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》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起,监察稽核部定期对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日、5日和10日时间窗分析同向交易中在价格差异的样本。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。

4.3.2 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

本基金在三季度的操作不尽如人意,虽然取得正收益,但与市场领先基金的收益率差距被拉开。截止季度末,本基金季度净值增长率为12.68%,业绩基准收益率为5.46%,超额收益为7.22%。

回顾三季度,管理人虽然在五月底已经意识到行情有向科技股行情演化的趋势和倾向,但对于网络传媒股的认识还是不够,一季度本基金已介入传媒股龙头品种,但在二季度传媒股进入高估值区域后就进行了获利了结,完全没有意识到这是一次网络传媒股的"市梦率"行情。在季度初,本基金仍持有一定仓位的电力设备和地产板块,在7月进行了调整,整体配置更加偏向了TMT、医药、消费、环保,TMT主要集中在电子和计算机,但传媒板块配置不足,所以导致在互联网和传媒大行情中落后市场优秀基金。9月,本基金略增加了对传媒板块的交易性投资,在三季度末,加大了对通信板块的配置,目前的配置结构仍旧以通信、电子、计算机、医药、传媒、消费为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年9月30日,本基金份额净值为1.1366元,本报告期份额净值增长率为12.68%,同期业绩比较基准增长率为5.46%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年四季度,我们对四季度的宏观经济依然持相对谨慎的看法。尽管三季度经济表现出弱复苏的态势,但从近期的景气调查和微观数据来看,经济增速再提升的空间不大,弱反弹已近尾声。四季度整体而言,预计经济增长将维持在相对不高、但可接受的水平上;金社会意义上的就业率仍然保持良好,物价水平虽然可能小幅上扬,但总体基本维持稳定;地方融资平台及金融系统继续今年以来的风险排查工作,流动性处在相对中性的环境中。从行业的角度看景气分化仍会继续,很多产能过剩的传统行业仍在去产能的过程中,盈利水平维持低位或呈下降趋势,部分消费相关的行业或新兴产业仍将维持较好的增长水平。外围方面,美联储决定暂不削减QE,流动性宽松的低利率环境得以延续,消除了新兴市场的部分短期风险,但中长期来看资金回流美国的趋势仍在,我国的外汇占款情况也很难出现系统性的改善;此外,美国政府关门、债务上限到期也导致市场预期波动,外围市场仍处于多事之秋。

市场方面,宏观大环境及行业的分化反映到市场上就表现为传统行业和新兴成长行业相关板块的估值分化,前者估值较低、基本面也有一些硬伤,后者估值较高、可能透支未来的增长;短期来看,除非有流动性的支撑或行业基本面的不确定性消除,传统行业很难形成持续上涨的趋势;受益于改革红利预期的行业仍是市场主线;长期来看,新兴产业相关的板块也会经历一个去伪存真的过程,需要经过业绩检验,需要我们从个体公司的竞争力出发、寻找优质公司进行投资。对于IPO开闸,我们改变之前的乐观看法,基于目前中小盘股票的估值水平,我们认为中小板和创业板的新股发行将在一个较高的估值水平上重启,如此以来,投资价值和机会将大大减少,还可能由于定价过高引发未来的价值回归,所以我们将谨慎对待之!尽管市场、经济都处于不断变化中,基金管理人仍将以不变的严谨心态、细致研究、在控制风险的前提下积极主动的寻找中长期的结构性投资机会,争取为投资者获取长期、稳定的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	44,235,330.00	73.01
	其中:股票	44,235,330.00	73.01
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,950,600.00	16.42
	其中:债券	9,950,600.00	16.42
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,396,447.70	2.30
7	其他各项资产	5,008,650.47	8.27
8	合计	60,591,028.17	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

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	64,800.00	0.11
B	采矿业	—	—
C	制造业	20,689,740.00	34.73
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	15,454,290.00	25.94
J	金融业	2,889,000.00	4.85
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	2,866,300.00	4.81
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	2,271,200.00	3.81
S	综合	—	—
	合计	44,235,330.00	74.26

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300074	华平股份	162,000	4,676,940.00	7.85
2	002241	歌尔声学	80,000	3,382,400.00	5.68
3	300038	梅泰诺	160,000	3,092,800.00	5.19
4	600705	中航投资	150,000	2,889,000.00	4.85
5	002236	大华股份	60,000	2,734,800.00	4.59
6	300047	天源迪科	240,000	2,505,600.00	4.21
7	600728	佳都新太	150,000	2,136,000.00	3.59
8	300273	和佳股份	80,000	1,918,400.00	3.22
9	002475	立讯精密	64,000	1,816,320.00	3.05
10	002653	海思科	70,000	1,612,100.00	2.71

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中:政策性金融债	—	—
4	企业债券	9,950,600.00	16.70
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	9,950,600.00	16.70

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112141	12金王债	100,000	9,950,600.00	16.70

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.2 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

5.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	62,325.51
2	应收证券清算款	2,215,430.73
3	应收股利	—
4	应收利息	471,403.97
5	应收申购款	2,259,490.26
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,008,650.47

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中不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

本报告期期初基金份额总额	63,687,966.95
本报告期基金总申购份额	35,927,843.01
减:本报告期基金总赎回份额	47,202,778.74
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	52,413,031.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,基金管理人不存在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

2013/07/17 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2013年第2季度报告

2013/08/21 富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司网上申购、定期定额费率优惠活动的公告

2013/08/29 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2013年半年度报告

2013/09/24 富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持有广股份(002400)估值调整的公告

2013/09/26 关于增加万银财富(北京)基金销售有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构及开通开放式基金非现场交易方式办理申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》

基金管理人业务资格批件和营业执照

基金托管人业务资格批件和营业执照

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

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