富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7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2014年4月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达信用纯债债券发起式	
基金主代码	000284	
交易代码	000284	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年10月25日	
报告期末基金份额总额	28,342,081.89份	
投资目标	本基金为纯债基金,在追求控制信用风险和保持基金资产流动性的基础上,力争获得超越比较基准的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	信用债券是本基金投资的核心主题,信用债券策略是本基金债券投资的核心策略。本基金将基于对整体收益率与信用利差的判断以及对发行人和发行条款的深入研究精选个券,确定具体信用债券的配置。 本基金计要从宏观经济周期的角度出发,基于对宏观经济周期、收益率曲线和信用利差的判断,分析并筛选出特定经济阶段下具有相对优势的期限与信用等级的债券进行配置。 本基金将利用目前的交易所和银行间两个投资市场的利差不同,密切关注两市场之间的利差波动情况,在两市场之间轮动切换,积极寻找两市场中现券和回购操作的套利机会。	
业绩比较基准	中债总指数收益率。	
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	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	富安达信用主题A	富安达信用主题C
下属两级基金的交易代码	000284	000285
报告期末下属两级基金的份额总额	17,689,980.85	10,652,101.04

§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(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	富安达信用主题A	富安达信用主题C
1.本期已实现收益	275,326.84	166,937.05
2.本期利润	532,661.49	337,338.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0284	0.0267
4.期末基金资产净值	18,556,357.22	11,131,283.92
5.期末基金份额净值	1.0490	1.0450

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本基金于2013年10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 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

富安达信用主题A

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	2.79%	0.13%	3.51%	0.11%	-0.72%	0.02%

富安达信用主题C

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	2.68%	0.13%	3.51%	0.11%	-0.83%	0.02%

注:①本基金业绩比较基准为: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:

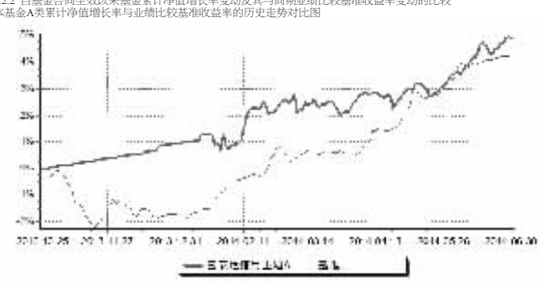
Return t =中债总财富总指数t / 中债总财富总指数(t-1) -1

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

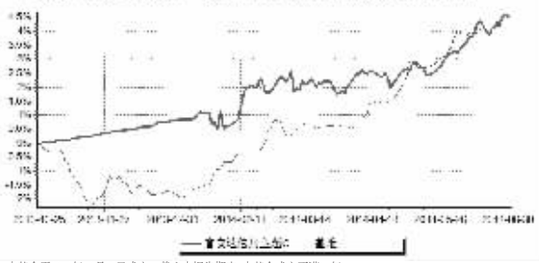
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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

本基金A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金B类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金于2013年10月25日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

§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,富安达增强收益债券型证券投资基金基金经理	2013年10月25日		11年	历任上海技术应用技术学院财政经济系教师;聚源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,博士研究生,具有基金从业资格,中国国籍
张凯瑜	本基金的基金经理,富安达现金通货币市场证券投资基金基金经理	2013年10月25日		6年	历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理员,爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍

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、《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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 公平交易制度的执行情况

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存在价格差异的样本。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

2014年二季度,债券市场强势反弹,得益于经济内生性增速继续低迷,PPI等指标持续运行在通缩区间,央行连续对部门商业银行进行定向降准和再贷款,无风险货币利率企稳回落。利率债短端出现了大幅回落,带动了收益率曲线陡峭化下移;信用品种收益率曲线也总体下行,但超日债等违约事件造成高等级信用债涨幅领先,信用利差有所扩大。5月后,一级市场招标需求持续旺盛,长久期受到热捧,国债期货连续上行,国债等利率产品收益率曲线呈平坦化下行走势。本基金加大了信用债和转债的配置,提升了杠杆水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,富安达信用纯债债券发起式A份额净值为1.0490元,C份额净值为1.0450元;富安达信用纯债债券发起式A份额净值增长率为2.79%,C份额净值增长率为2.68%,同期业绩比较基准增长率为3.51%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央政府不断微调政策趋向,保增长的意图和决心显著,6月以来,表征经济指标开始了止跌企稳,货币政策继续温和,资金价格水平依旧平稳,基本面上对债市依旧强力支撑,下半年信用债和转债有望有超额收益。信用主题纯债基金将挖掘信用债轮动的投资机会,布局转债的交易良机,争取为基金持有人创造良好回报。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	36,835,113.95	93.38
	其中:债券	36,835,113.95	93.38
	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	1,758,799.33	4.46
8	其他各项资产	850,644.35	2.16
9	合计	39,444,557.63	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	1,616,836.00	5.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	18,009,241.30	60.66
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,994,000.00	33.66
7	可转债	7,215,036.65	24.30
8	其他	-	-
9	合计	36,835,113.95	124.08

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	10,000,000.00	33.68
2	1282490	12川国核MTN1	100,000	9,994,000.00	33.66
3	122900	10杭通02	30,380	3,129,140.00	10.54
4	128005	齐翔转债	24,165	2,570,431.05	8.66
5	110022	同仁转债	16,600	1,898,708.00	6.40

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。

5.7 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

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待仓和损益明细

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 本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3 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	12,763.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	836,982.75
5	应收申购款	897.62
6	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	850,644.35

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	1,898,708.00	6.40
2	128003	华天转债	1,694,653.60	5.71
3	110018	国电转债	313,080.00	1.05

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

	富安达信用主题A	富安达信用主题C
本报告期期初基金份额总额	20,100,610.15	14,601,125.55
本报告期基金总申购份额	785,516.20	157,101.26
减:本报告期基金总赎回份额	3,196,145.50	4,106,125.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,689,980.85	10,652,101.04

注:本基金于2013年10月25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

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	35.28

注:本报告期内,基金管理人运用固有资金投资本基金运作合规,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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,000.00	35.28%	9,999,000.00	35.28%	
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	9,999,000.00	35.28%	9,999,000.00	35.28%	

§9 影响投资者决策的其他重要信息

2014/04/21 富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金2014年第1季度报告

2014/06/09 富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(二〇一四年第一号)

2014/06/09 富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一四年第一号)

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

中国证监会批准富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金设立的文件

《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》

《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合同》

《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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

10.2 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。

10.3 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

富安达现金通货币市场证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年07月18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2014年7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2014年4月1日起至6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	91,977,636.41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	21,155,512.25	70,822,124.16

§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(2014年04月01日-2014年06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	290,732.18	976,812.63
2.本期利润	290,732.18	976,812.63
3.期末基金资产净值	21,155,512.25	70,822,124.16

注: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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

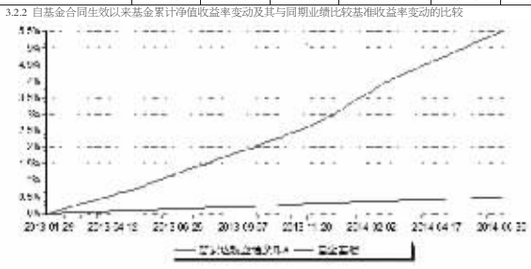
1、富安达现金通货币A

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	0.9808%	0.0042%	0.0873%	0.0000%	0.8935%	0.0042%

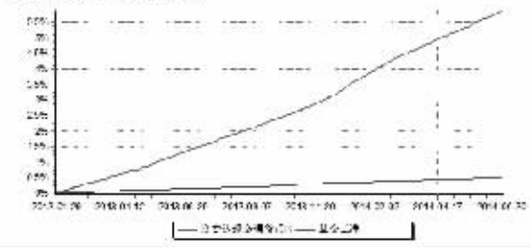
2、富安达现金通货币B

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	1.0413%	0.0042%	0.0873%	0.0000%	0.9540%	0.0042%

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



[illegible]



注:本基金于2013年1月29日成立。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。本报告期内,本基金限额回而被动超标的情况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		
张凯瑜	本基金的基金经理,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01月29日	-	6年	历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理员;爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍

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 报告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 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《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存在价格差异的样本。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

报告期内市场流动性较为宽裕,资金价格处于低位,债市在平稳的流动性、正面的货币政策预期下呈走强趋势。央行态度回暖,资金维持低位,收益率曲线小幅下行,整体变平。一级市场认购较为热情,机构配置需求旺盛,发行利率稳中有降;二级市场利率债、信用债收益率普遍下行。报告期内我们增加了中高等级短期债券的仓位,并对同存、回购等资产进行了动态配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内富安达现金通货币A份额净值收益率为0.9808%,富安达现金通货币B份额净值收益率为1.0413%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度宏观数据显示经济略有反弹,央行定向降准扩大定向宽松范围,流动性有望持续宽松,市场风险偏好预计会得到提升。临近半年末时点,部分交易型机构获利回吐,预计接下来牛市行情将会趋缓。近期银监会发布的《中国银监会关于调整商业银行存款比计算口径的通知》,进一步缩小贷款计算口径、扩大存款计算口径,通过存款比分子分母范围的调整,来适当增加信贷资金供给,受到流动性宽松预期影响,资金成本预计会保持在比较稳定的范围内。信用债投资价值将超过利率品种,我们接下来会关注中等评级信用品种,并根据市场情况及时调整债券久期和组合资产。

§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	固定收益投资	70,282,947.70	68.07
	其中:债券	70,282,947.70	68.07
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	30,589,373.66	29.63
4	其他资产	2,382,291.95	2.31
5	合计	103,254,613.31	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	3.77
	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	10,889,794.55	11.84
	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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	122
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

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	11.52	11.84
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	10.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	32.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	43.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	10.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		109.67	11.84

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	10,009,696.45	10.88
	其中:政策性金融债	10,009,696.45	10.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,273,251.25	65.53
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	70,282,947.70	76.41
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	041373008	13国安集CP002	100,000	10,112,752.04	10.99
2	041356043	13中广核CP001	100,000	10,059,381.83	10.94
3	041364038	13天山水泥CP003	100,000	10,043,616.12	10.92
4	041351049	13大国资CP002	100,000	10,038,058.36	10.91
5	041366011	13津保投CP002	100,000	10,012,856.73	10.89
6	140204	14国开04	100,000	10,009,696.45	10.88
7	041356023	13桂投资CP001	100,000	10,006,586.17	10.88

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	11
报告期内偏离度的最高值	0.4197%
报告期内偏离度的最低值	0.0286%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1854%

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	2,315,725.59
4	应收申购款	66,566.36
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	2,382,291.95

§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	22,134,226.88	82,958,667.17
本报告期基金总申购份额	40,179,996.08	61,010,297.22
减:本报告期基金总赎回份额	41,158,710.71	73,146,840.23
本报告期期末基金份额总额	21,155,512.25	70,822,124.16

注:报告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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014年06月04日	9,000,000.00	9,000,000.00	-
2	赎回	2014年06月11日	1,000,000.00	1,000,000.00	-
3	赎回	2014年06月19日	11,000,000.00	11,000,000.00	-

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2014/04/21富安达现金通货币市场证券投资基金2014年第1季度报告

2014/04/28关于富安达现金通货币市场证券投资基金2014年五一假期前暂停申购(含定投及转换转入)业务的公告

§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现金通货币市场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

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
二〇一四年七月十八日

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6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:2014年7月18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2014年7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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达策略精选灵活配置混合
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	40,833,902.09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。
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(2014年4月1日-