# 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2014 半年度 报告摘要

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
送出日期:2014年8月28日

## §1 重要提示

1.1 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。本半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2014年8月27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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

## §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 | 40,833,902.09份 |
| 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 | 刘涛 | 王涛 |
| | 联系电话 | 021-61870999 | 95559 |
| | 电子邮箱 | service@fadfunds.com | t_wang@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-630-6999(免长途)021-61870666 | 95559 |
| 传真 | | 021-61870888 | 021-62701216 |
| 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 | 上海市浦东新区银城中路188号 |
| 邮政编码 | | 200122 | 200120 |
| 法定代表人 | | 秦雁 | 牛锡明 |

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》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.fadfunds.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2014年1月1日至2014年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 208,909.95 |
| 本期利润 | 2,954,827.32 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0673 |
| 本期加权平均净值利润率 | 6.58% |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.26% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 1,414,377.43 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0346 |
| 期末基金资产净值 | 42,248,279.52 |
| 期末基金份额净值 | 1.0346 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 7.26% |

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。

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 5.85% | 1.25% | 0.39% | 0.43% | 5.46% | 0.82% |
| 过去三个月 | 2.78% | 1.30% | 1.01% | 0.48% | 1.77% | 0.82% |
| 过去六个月 | 4.26% | 1.46% | -3.03% | 0.57% | 7.29% | 0.89% |
| 过去一年 | 2.57% | 1.51% | 0.78% | 0.65% | 1.79% | 0.86% |
| 自基金合同生效日起至今(2012年04月25日-2014年06月30日) | 7.26% | 1.26% | -5.91% | 0.69% | 13.17% | 0.57% |

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,

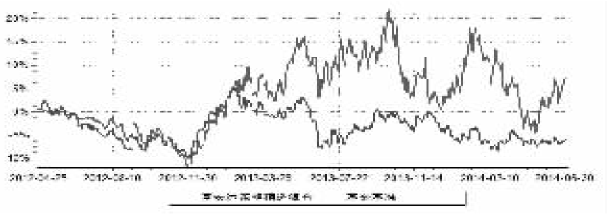
2、本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

$$Return_t = 55\%\times[\text{沪深300指数}_t/\text{沪深300指数}_{(t-1)}-1]+45\%\times[\text{上证国债指数}_t/\text{上证国债指数}_{(t-1)}-1]$$

$$Benchmark_t = (1+Return_t)\times Benchmark_{(t-1)}$$

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4月25日成立,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责任公司、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2014年6月30日,公司共管理五只开放式基金: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、富安达现金通货币市场证券投资基金和富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金。

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 | - | 20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,监察稽核部分季度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,1分日、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 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

上半年管理人对市场的判断是主板市场仍旧以低位震荡区间波动为主,上涨无望,大幅下跌也不太现实;对于创业板市场的结构性行情相对看好;A股市场整体上处于"存量经济、存量资金、存量市场"的格局下运行。但是综合国内经济增长态势,经济结构调整格局来看,未来两三年,国内资本市场的机会应该仍旧主要来自于战略性新兴产业,因此管理人仍旧将大部分基金资产配置在新兴产业板块上。一季度,积极挖掘了游戏、移动互联网、智慧城市、医疗器械与服务、高端装备制造等板块的投资机会,取得较好的投资收益,但在三月份的创业板市场回调中未能及时兑现盈利,净值遭受较大回撤。自五月份以后,由于"微刺激"与"定向降准"的信号和措施越来越强,市场基本告别"钱荒"在二季度末再度来袭的担忧,市场情绪有所回暖;同时,"微刺激"与"定向降准"的政策也让市场更清晰的认识到高层对于经济结构调整的决心,所以市场上行的动能再度迅速向以TMT、医疗、新能源(汽车)、高端装备制造为代表的中小板、创业板聚集,基金管理人也积极加大操作力度,提高资金效率,挖掘个股机会,取得一定成效。上半年总体而言,投资机会捕捉尚可,但风险防范与回撤控制仍有待加强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2014年6月30日,本基金份额净值为1.0346元,份额累计净值为1.0746元。本报告期基金份额净值增长率为4.26%,同期基金业绩比较基准的收益率为-3.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年下半年,预计经济仍将在衰退与复苏之间摇摆。年初以来,一系列的稳增长政策使经济增长有所企稳,主要反映在工业增加值同比略有反弹、PMI反弹、PPI环比跌幅收窄。虽然导致长期潜在经济增速下行的核心要素仍然存在,但在短期稳增长背景下,中枢下移被大大延缓,经济风险得不到充分释放。展望下半年,限购取消等地产政策的放松只能延缓、并不能逆转地产成交下滑的趋势,房地产总量上供过于求的压力已成事实,成交下降导致房地产投资仍面临压力,整体产能过剩的大背景下制造业投资难见起色,消费仍将顺周期下行;短期微刺激之下,基建投资已经开始发力,但受制于社会融资规模,力度相对有限;出口增速的回升受海外需求回暖以及人民币贬值影响,是否能持续还有待观察;整体来看,经济周期性下行压力依然存在,但底线思维托底的努力也不会放弃。海外方面,美国经济增速回升,就业稳步改善,下半年美国经济将呈现逐季走高的态势,美元、美债收益率筑底回升的概率较大;欧洲央行相对积极的货币政策下,经济复苏的综合环境仍处于边际改善之中;在发达经济体复苏的背景下,货币回流发达经济体,新兴经济体经济运行的压力依然较大,新兴市场与发达经济体景气双速格局依然在延续。

市场方面,下半年流动性环境可能较为宽松,央行的货币政策更多的使用价格工具进行调控,短端利率较为稳定,定向降准和定向再贷款政策有助于中长期利率的下行,有利于市场估值的提升。虽然短期周期类行业的个股有一定幅度的反弹,但综合考虑宏观环境等因素,受益于改革红利、景气度较高的新兴行业仍是长期的市场主线。此外,在流动性宽松的背景下,与市场改革以及国际政治局势相关的主题投资也值得更多的关注。近期市场结构变化较快,加大了组合管理的难度,尽管如此,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。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

## §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

2014年上半年度,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

2014年上半年度,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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2014年上半年度,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投资基金的半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2014年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 488,783.09 | 946,222.57 |
| 结算备付金 | | 3,253,521.31 | 9,447,921.85 |
| 存出保证金 | | 50,531.06 | 64,746.39 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 30,868,795.06 | 39,354,772.15 |
| 其中:股票投资 | | 30,868,795.06 | 39,354,772.15 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 5,000,121.50 | 4,000,126.00 |
| 应收证券清算款 | | 4,001,666.67 | 6,491,861.91 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 3,568.64 | 7,174.45 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,185.17 | 5,579.05 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 43,668,172.50 | 60,318,404.37 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 832,839.23 | - |
| 应付赎回款 | | 64,204.74 | 102,823.12 |
| 应付管理人报酬 | | 51,080.07 | 73,904.42 |
| 应付托管费 | | 8,513.36 | 12,317.41 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 109,410.97 | 176,203.20 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 353,844.61 | 260,387.52 |
| 负债合计 | | 1,419,892.98 | 625,635.67 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 40,833,902.09 | 60,153,603.81 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 1,414,377.43 | -460,835.11 |
| 所有者权益合计 | | 42,248,279.52 | 59,692,768.70 |
| 负债和所有者权益总计 | | 43,668,172.50 | 60,318,404.37 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0346元,基金份额总额40,833,902.09份。

6.2 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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日-2013年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 3,928,259.91 | 12,163,107.08 |
| 1.利息收入 | | 80,187.94 | 416,282.93 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 51,066.92 | 55,329.43 |
| 债券利息收入 | | - | 360,754.50 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 29,121.02 | 199.00 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 1,069,243.89 | 23,149,613.71 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | 1,017,968.59 | 22,730,395.67 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | 142,331.79 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.1 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.17 | 51,275.30 | 276,886.25 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.18 | 2,745,917.37 | -11,553,119.34 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列 | 6.4.7.19 | 32,910.71 | 150,329.78 |
| 减:二、费用 | | 973,432.59 | 1,784,117.66 |
| 1.管理人报酬 | | 333,978.84 | 681,166.46 |
| 2.托管费 | | 55,663.15 | 113,527.74 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.交易费用 | 6.4.7.20 | 410,570.65 | 792,280.47 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.其他费用 | 6.4.7.21 | 173,219.95 | 197,142.99 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 2,954,827.32 | 10,378,989.42 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 2,954,827.32 | 10,378,989.42 |

6.3 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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30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) | 60,153,603.81 | -460,835.11 | 59,692,768.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 2,954,827.32 | 2,954,827.32 |
| 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) | -19,319,701.72 | -1,079,614.78 | -20,399,316.50 |
| 其中:1.基金申购款 | 8,952,906.82 | 151,020.23 | 9,103,927.05 |
| 2.基金赎回款(以“-”号填列) | -28,272,608.54 | -1,230,635.01 | -29,503,243.55 |
| 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) | 40,833,902.09 | 1,414,377.43 | 42,248,279.52 |

| 项 目 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日-2013年6月30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) | 168,612,550.24 | -3,392,445.49 | 165,220,104.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 10,378,989.42 | 10,378,989.42 |
| 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) | -104,924,583.29 | -4,096,427.04 | -109,021,010.33 |
| 其中:1.基金申购款 | 20,206,714.64 | 1,343,444.91 | 21,550,159.55 |
| 2.基金赎回款(以“-”号填列) | -125,131,297.93 | -5,439,871.95 | -130,571,169.88 |
| 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) | - | -2,336,249.43 | -2,336,249.43 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 63,687,966.95 | 553,867.46 | 64,241,834.41 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至财务报表由下列负责人签署:

| | | |
|---|---|---|
| 蒋晓刚 | 刘涛 | 顾颖 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]193号《关于核准富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由富安达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息的净认购资金为583,296,937.09元,经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第118号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达策略精选混合型证券投资基金基金合同》于2012年4月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为583,363,852.64份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达策略精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、银行存款、资产支持证券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票投资占基金资产的比例为30-80%,债券投资占基金资产的比例为0-65%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其它的产品,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会于2010年2月8日发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达策略精选混合型证券投资基金基金合同》及中国证监会颁布的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量,应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.6 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.7 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认,并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.11 分部报告

无。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作, 本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

1、对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入,由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。其中,对基金从上市公司分配取得的股息红利所得,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额。

4、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,关联方关系未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 富安达资产管理(上海)有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期内未及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付给关联方的佣金。

6.4.9.1.4 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日-2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 333,978.84 | 681,166.46 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 94,288.33 | 250,786.86 |

注:1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下: 每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×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管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日-2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 55,663.15 | 113,527.74 |

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下: 每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均没有与关联方进行银行间同业市场的的债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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:份

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日-2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 9,999,000.00 | 9,999,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 9,999,000.00 | 9,999,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 24.49% | 15.70% |

注:本基金管理人在本期末申购、赎回本基金,基金份额未发生变动。

6.4.9.4.2 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。

6.4.9.5 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<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日-2013年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行 | 488,783.09 | 21,380.02 | 3,658,737.76 | 10,202.48 |

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2014年6月30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。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内及上年度可比期间内均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.11 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

| 6.4.11.1.1 受限证券类别:股票 | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
| 002727 | 一心堂 | 2014-06-25 | 2014-07-02 | 网上发行公开发行新股未流通受限 | 12.20 | 12.20 | 500 | 6,100.00 | 6,100.00 |

6.4.11.2 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等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告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。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告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 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 30,868,795.06 | 70.69 |
| | 其中:股票 | 30,868,795.06 | 70.69 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 5,000,121.50 | 11.45 |
| | 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 | 3,742,304.40 | 8.57 |
| 7 | 其他资产 | 4,056,951.54 | 9.29 |
| 8 | 合计 | 43,668,172.50 | 100.00 |

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.2 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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 1,666,700.00 | 3.95 |
| C | 制造业 | 16,537,645.16 | 39.14 |
| 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 | 6,100.00 | 0.01 |
| 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 | 12,242,117.90 | 28.98 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 416,232.00 | 0.99 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 30,868,795.06 | 73.07 |

7.3 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

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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300020 | 银江股份 | 70,000 | 2,142,000.00 | 5.07 |
| 2 | 300043 | 互动娱乐 | 115,000 | 2,132,100.00 | 5.05 |
| 3 | 300024 | 机器人 | 65,000 | 1,911,000.00 | 4.52 |
| 4 | 002583 | 海能达 | 69,700 | 1,900,022.00 | 4.50 |
| 5 | 300182 | 捷成股份 | 90,000 | 1,804,500.00 | 4.27 |
| 6 | 300084 | 海默科技 | 70,000 | 1,666,700.00 | 3.95 |
| 7 | 002642 | 荣之联 | 61,500 | 1,411,425.00 | 3.34 |
| 8 | 300299 | 富春通信 | 110,091 | 1,411,366.62 | 3.34 |
| 9 | 300113 | 顺网科技 | 56,000 | 1,355,200.00 | 3.21 |
| 10 | 300273 | 和佳股份 | 44,000 | 1,350,800.00 | 3.20 |
| 11 | 002405 | 四维图新 | 80,000 | 1,329,600.00 | 3.15 |
| 12 | 002223 | 鱼跃医疗 | 50,000 | 1,212,500.00 | 2.87 |
| 13 | 600217 | 秦岭水泥 | 190,000 | 1,172,300.00 | 2.77 |
| 14 | 300075 | 数字政通 | 35,136 | 1,135,946.88 | 2.69 |
| 15 | 600525 | 长园集团 | 99,899 | 1,102,884.96 | 2.61 |
| 16 | 002678 | 珠江钢琴 | 100,000 | 935,000.00 | 2.21 |
| 17 | 002117 | 东港股份 | 50,760 | 878,148.00 | 2.08 |
| 18 | 002353 | 杰瑞股份 | 20,226 | 814,096.50 | 1.93 |
| 19 | 002191 | 劲嘉股份 | 55,000 | 731,500.00 | 1.73 |
| 20 | 002174 | 游族网络 | 12,820 | 705,484.60 | 1.67 |
| 21 | 002219 | 恒康医疗 | 32,000 | 703,360.00 | 1.66 |
| 22 | 600699 | 均胜电子 | 26,070 | 655,139.10 | 1.55 |
| 23 | 300352 | 北信源 | 30,221 | 646,729.40 | 1.53 |
| 24 | 300017 | 网宿科技 | 9,000 | 574,200.00 | 1.36 |
| 25 | 002268 | 卫士通 | 11,000 | 407,550.00 | 0.96 |
| 26 | 002400 | 省广股份 | 14,400 | 353,952.00 | 0.84 |
| 27 | 002559 | 亚威股份 | 10,000 | 202,700.00 | 0.48 |
| 28 | 000812 | 陕西金叶 | 10,000 | 75,000.00 | 0.18 |
| 29 | 300071 | 华谊嘉信 | 4,000 | 62,280.00 | 0.15 |
| 30 | 002555 | 顺荣股份 | 1,000 | 47,080.00 | 0.11 |
| 31 | 002373 | 千方科技 | 1,000 | 23,600.00 | 0.06 |
| 32 | 002726 | 龙大肉食 | 500 | 8,530.00 | 0.02 |
| 33 | 002727 | 一心堂 | 500 | 6,100.00 | 0.01 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300043 | 互动娱乐 | 3,391,089.76 | 5.68 |
| 2 | 002219 | 恒康医疗 | 3,256,382.42 | 5.46 |
| 3 | 300017 | 网宿科技 | 2,806,999.86 | 4.70 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 2,779,380.31 | 4.66 |
| 5 | 002635 | 安洁科技 | 2,748,470.64 | 4.60 |
| 6 | 002416 | 爱施德 | 2,604,036.00 | 4.36 |
| 7 | 002555 | 顺荣股份 | 2,471,075.00 | 4.14 |
| 8 | 002583 | 海能达 | 2,366,430.00 | 3.96 |
| 9 | 002148 | 北纬通信 | 2,301,824.70 | 3.86 |
| 10 | 300177 | 中海达 | 2,279,809.07 | 3.82 |
| 11 | 600699 | 均胜电子 | 2,254,265.11 | 3.78 |
| 12 | 002405 | 四维图新 | 2,212,504.55 | 3.71 |
| 13 | 300298 | 三诺生物 | 2,199,586.11 | 3.68 |
| 14 | 002191 | 劲嘉股份 | 2,194,313.25 | 3.68 |
| 15 | 002230 | 科大讯飞 | 2,166,528.00 | 3.63 |
| 16 | 002195 | 海隆软件 | 2,158,712.00 | 3.62 |
| 17 | 002353 | 杰瑞股份 | 2,153,581.74 | 3.61 |
| 18 | 002390 | 信邦制药 | 2,134,277.15 | 3.58 |
| 19 | 300059 | 东方财富 | 2,087,631.00 | 3.50 |
| 20 | 300020 | 银江股份 | 1,973,391.10 | 3.31 |
| 21 | 300170 | 汉得信息 | 1,949,894.00 | 3.27 |
| 22 | 300024 | 机器人 | 1,899,209.55 | 3.18 |
| 23 | 002312 | 三泰电子 | 1,881,834.90 | 3.15 |
| 24 | 300182 | 捷成股份 | 1,865,322.51 | 3.12 |
| 25 | 300084 | 海默科技 | 1,852,782.00 | 3.10 |
| 26 | 002292 | 奥飞动漫 | 1,844,527.94 | 3.09 |
| 27 | 002049 | 同方国芯 | 1,822,247.00 | 3.05 |
| 28 | 000988 | 华工科技 | 1,721,760.00 | 2.88 |
| 29 | 300251 | 光线传媒 | 1,708,934.20 | 2.86 |
| 30 | 600588 | 用友软件 | 1,679,020.00 | 2.81 |
| 31 | 300352 | 北信源 | 1,670,334.56 | 2.80 |
| 32 | 002174 | 游族网络 | 1,641,014.20 | 2.75 |
| 33 | 002373 | 千方科技 | 1,591,558.00 | 2.67 |
| 34 | 002527 | 新时达 | 1,492,432.00 | 2.50 |
| 35 | 300248 | 新开普 | 1,473,488.00 | 2.47 |
| 36 | 002614 | 蒙发利 | 1,446,235.20 | 2.42 |
| 37 | 600079 | 人福医药 | 1,432,219.00 | 2.40 |
| 38 | 600522 | 中天科技 | 1,399,715.88 | 2.34 |
| 39 | 002660 | 茂硕电源 | 1,399,082.50 | 2.34 |
| 40 | 600446 | 金证股份 | 1,386,866.00 | 2.32 |
| 41 | 002396 | 星网锐捷 | 1,358,980.00 | 2.28 |
| 42 | 002642 | 荣之联 | 1,310,378.20 | 2.20 |
| 43 | 002410 | 广联达 | 1,301,395.00 | 2.18 |
| 44 | 600566 | 洪城股份 | 1,276,282.90 | 2.14 |
| 45 | 002502 | 骅威股份 | 1,263,047.00 | 2.12 |
| 46 | 002223 | 鱼跃医疗 | 1,251,870.00 | 2.10 |
| 47 | 000541 | 佛山照明 | 1,249,095.99 | 2.09 |
| 48 | 300113 | 顺网科技 | 1,245,505.95 | 2.09 |
| 49 | 600525 | 长园集团 | 1,236,214.20 | 2.07 |
| 50 | 600217 | 秦岭水泥 | 1,220,026.50 | 2.04 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002475 | 立讯精密 | 5,026,960.04 | 8.42 |
| 2 | 300315 | 掌趣科技 | 4,009,233.00 | 6.72 |
| 3 | 600372 | 中航电子 | 3,286,987.80 | 5.51 |
| 4 | 002465 | 海格通信 | 3,247,865.97 | 5.44 |
| 5 | 600118 | 中国卫星 | 3,003,416.40 | 5.03 |
| 6 | 002415 | 海康威视 | 2,717,420.30 | 4.55 |
| 7 | 002292 | 奥飞动漫 | 2,708,239.59 | 4.54 |
| 8 | 600292 | 中电远达 | 2,600,859.00 | 4.36 |
| 9 | 002635 | 安洁科技 | 2,566,317.65 | 4.30 |
| 10 | 300177 | 中海达 | 2,535,588.19 | 4.25 |
| 11 | 002555 | 顺荣股份 | 2,449,275.00 | 4.10 |
| 12 | 300017 | 网宿科技 | 2,410,538.50 | 4.04 |
| 13 | 300020 | 银江股份 | 2,396,726.32 | 4.02 |
| 14 | 002195 | 海隆软件 | 2,360,334.04 | 3.95 |
| 15 | 002416 | 爱施德 | 2,356,166.99 | 3.95 |
| 16 | 002148 | 北纬通信 | 2,337,581.84 | 3.92 |
| 17 | 002230 | 科大讯飞 | 2,280,100.00 | 3.82 |
| 18 | 002390 | 信邦制药 | 2,236,893.00 | 3.75 |
| 19 | 300170 | 汉得信息 | 2,117,400.00 | 3.55 |
| 20 | 300024 | 机器人 | 2,091,005.00 | 3.50 |
| 21 | 600588 | 用友软件 | 2,076,250.00 | 3.48 |
| 22 | 002219 | 恒康医疗 | 2,069,400.00 | 3.47 |
| 23 | 600038 | 哈飞股份 | 2,065,225.50 | 3.46 |
| 24 | 002373 | 千方科技 | 2,065,035.00 | 3.46 |
| 25 | 300059 | 东方财富 | 1,936,579.00 | 3.24 |
| 26 | 600887 | 伊利股份 | 1,928,584.00 | 3.23 |
| 27 | 300251 | 光线传媒 | 1,918,249.36 | 3.21 |
| 28 | 300155 | 安居宝 | 1,876,595.00 | 3.14 |
| 29 | 002049 | 同方国芯 | 1,874,960.00 | 3.14 |
| 30 | 300273 | 和佳股份 | 1,819,180.00 | 3.05 |
| 31 | 000988 | 华工科技 | 1,794,000.00 | 3.01 |
| 32 | 300248 | 新开普 | 1,759,407.00 | 2.95 |
| 33 | 300298 | 三诺生物 | 1,756,157.25 | 2.94 |
| 34 | 002294 | 信立泰 | 1,750,874.00 | 2.93 |
| 35 | 002312 | 三泰电子 | 1,706,307.52 | 2.86 |
| 36 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,689,847.81 | 2.83 |
| 37 | 600699 | 均胜电子 | 1,531,844.30 | 2.57 |
| 38 | 002660 | 茂硕电源 | 1,502,081.00 | 2.52 |
| 39 | 600079 | 人福医药 | 1,501,050.00 | 2.51 |
| 40 | 600566 | 洪城股份 | 1,449,213.40 | 2.43 |
| 41 | 600446 | 金证股份 | 1,430,900.00 | 2.40 |
| 42 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,390,600.00 | 2.33 |
| 43 | 300183 | 东软载波 | 1,351,879.35 | 2.26 |
| 44 | 300043 | 互动娱乐 | 1,350,616.00 | 2.26 |
| 45 | 002614 | 蒙发利 | 1,334,427.80 | 2.24 |
| 46 | 002126 | 银轮股份 | 1,293,250.00 | 2.17 |
| 47 | 002396 | 星网锐捷 | 1,292,613.00 | 2.17 |
| 48 | 600522 | 中天科技 | 1,292,492.99 | 2.17 |
| 49 | 002653 | 海思科 | 1,267,560.00 | 2.12 |
| 50 | 002573 | 国电清新 | 1,258,800.00 | 2.11 |
| 51 | 300110 | 华仁药业 | 1,231,206.00 | 2.06 |
| 52 | 002410 | 广联达 | 1,208,532.19 | 2.02 |

注:本项"卖出金额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票的成本(成交)总额 | 126,496,560.38 |
| 卖出股票的收入(成交)总额 | 138,746,423.43 |

注:本项"买入股票的成本(成交)总额"和"卖出股票的收入(成交)总额"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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 | 50,531.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,001,666.67 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,568.64 |
| 5 | 应收申购款 | 1,185.17 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,056,951.54 |

7.9.4 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处于转股期的可转换债券。

7.9.5 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。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 712 | 57,350.99 | 18,691,022.60 | 45.77% | 22,142,879.49 | 54.23% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 21,522.80 | 0.05% |

注:1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0至10万份(含)。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0.98 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

注:1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0至10万份(含)。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2012年4月25日)基金份额总额 | 583,363,852.64 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 60,153,603.81 |
| 本报告期基金总申购份额 | 8,952,906.82 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 28,272,608.54 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 40,833,902.09 |

注:总申购份额含红利再投资、转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

## §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金管理人的重大人事变动:

根据《公司法》和《富安达基金管理有限公司章程》的规定,富安达基金管理有限公司于2014年4月3日在公司召开职工大会,经与会职工民主投票,同意孔学兵同志为富安达基金管理有限公司第二届职工董事。

经富安达基金管理有限公司第一届董事会第十七次会议审议通过,同意董事长张华东同志因已届法定退休年龄辞去董事长(法定代表人)职务,聘任秦雁同志为公司董事会董事长(法定代表人。本基金管理人已于2014年4月17日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了富安达基金管理有限公司高级管理人变更的公告。总经理变更事项已向中国证券监督管理委员会和上海监管局报告,经中国证券监督管理委员会证监许可[2014]412号文核准批复。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为审计师。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,本基金管理人未受到任何处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 光大证券 | 1 | 14,355,243.20 | 5.41% | 13,068.87 | 5.41% | |
| 国泰君安 | 1 | 16,931,633.05 | 6.38% | 15,414.52 | 6.38% | |
| 海通证券 | 1 | 9,123,781.30 | 3.44% | 8,306.27 | 3.44% | |
| 兴业证券 | 2 | 97,589,661.36 | 36.80% | 88,845.52 | 36.80% | |
| 招商证券 | 2 | 127,221,644.90 | 47.97% | 115,822.61 | 47.97% | |
| 国金证券 | 2 | | - | - | - | |
| 申银万国 | 2 | | - | - | - | |
| 广发证券 | 2 | | - | - | - | |
| 南京证券 | 2 | | - | - | - | |
| 中信证券 | 2 | | - | - | - | |
| 华泰证券 | 1 | | - | - | - | |
| 银河证券 | 1 | | - | - | - | |
| 东方证券 | 2 | | - | - | - | |
| 中金公司 | 1 | | - | - | - | |

注:①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

(一)财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生;

(二)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(三)能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他信息咨询服务;

(四)能根据公司特定要求,提供专门研究报告;

(五)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务;能够提供很好的交易执行。

②券商专用交易单元选择程序:

(一)券商席位由投资管理部与研究发展部业务人员推荐,经投资管理部、研究发展部部门会议讨论,形成重点评估的券商备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

(二)投资管理部、研究发展部全体业务人员遵照券商选择标准的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成券商排名及专用席位租用意见,报公司总经理批准。

(三)公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议,明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等,经签章有效。

(四)若签约券商的服务不能满足要求,或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚,公司可以提前终止签署的协议,并撤销租用的席位。

③本报告期内,本基金减少租用红塔证券的一个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额比例 |
| 光大证券 | - | - | 500,000.00 | 1.75% | - | - |
| 国泰君安 | - | - | 4,500,000.00 | 15.79% | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | 23,500,000.00 | 82.46% | - | - |
| 国金证券 | | - | | - | | - |
| 申银万国 | | - | | - | | - |
| 广发证券 | | - | | - | | - |
| 南京证券 | | - | | - | | - |
| 中信证券 | | - | | - | | - |
| 华泰证券 | | - | | - | | - |
| 银河证券 | | - | | - | | - |
| 东方证券 | | - | | - | | - |
| 中金公司 | | - | | - | | - |

富安达基金管理有限公司
二〇一四年八月二十八日