富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014年10月27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10月24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	35,334,870.74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7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	1,269,371.28
2.本期利润	3,347,984.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0837
4.期末基金资产净值	39,866,318.16
5.期末基金份额净值	1.1282

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自《公开募集证券投资基金运作管理办法》发布之日起至本季度末,本基金净资产已连续20个工作日低于5000万。

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

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	9.05%	1.02%	7.66%	0.49%	1.39%	0.53%

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,

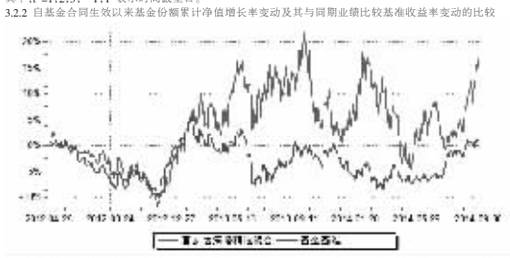
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

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



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。本报告期内,本基金因赎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		
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	-	20年	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,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 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,按照标准计算周期,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

三季度市场波动较大,季度初始A股市场面临较大回调压力,宏观数据的不稳定和TMT行业的短期涨幅较大带来市场较大的回调压力,但在央行不断推进定向降准的宽松措施努力下,以及防腐工作持续取得重要成绩的刺激下,国别溢价上升,市场的风险偏好显著上升,无风险利率的持续下降也带来资产配置的格局变化,债市的持续牛市一定程度上封杀了市场对金融风险的担忧,央行在资产端的持续努力改善了市场对金融市场前景的预期,而沪港通的出台在一定程度上改善了投资者对存量资金的纠结。在新能源汽车与军工板块的带领下,在融资盘资金的推动下,A股在7月末开始有力上涨,三季度沪深300指数上涨13.20%。

从操作上来说,7月份未能及时注意控制风险,基金业绩表现较差;8月通过调整布局,绩效有所改进;9月业绩继续提升。四季度,本基金将着重策略选股,重点关注信息技术、消费电子,医疗服务、军工装备,高端制造等战略新兴产业中有核心竞争力和优势的企业,以避免未来在潮水退去后的尴尬局面,同时针对今年市场特点,对于外延式扩张,资产重组等热点也适当关注,但在新股及类新股估值都趋于泡沫化的四季度,需要更加严谨的选择标的,着重企业基本面研究和估值的安全边际,以防陷入"伪成长"陷阱。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.1282元,本报告期份额净值增长率为9.05%,同期业绩比较基准增长率为7.66%。

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2014年四季度,经济形势增长仍然有压力,从三季度的情况来看,经济增长未能延续二季度的复苏趋势,8月份经济数据出现大范围的回落,投资、工业产出等指标均现恶化,这员与去年同期高基数的影响有关,但环比数据的回落则进一步说明经济复苏过程仍然权坷,流动性方面,三季度央行发放了5000亿SLF,调低回购利率以及放松了房贷政策,央行定向降准与引导资金利率下行的意图十分明显,但是仍然不必期待货币政策的全面宽松,目前央行有更多的货币工具可供选择,在确定宽松趋势的格局下,央行将通过主动性的货币工具选择,来对实体经济进行精准投放,展望四季度,经济增速承压令稳增长的必要性依然存在,尽管相对稳定的就业环境令政府对经济增速下滑的容忍度有所提升,但是管理层仍策要通过宽松的财政货币政策维护经济增速的相对稳定,为逐级展开的各项改革创造较好的实施环境,总体来看,在社会融资增速放缓,而刺激政策力度有限的背景下,我们认为经济增速继续缓慢下行是大概率事件,四季度居然基数变化利于同比增速较三季度有所改善,但下行压力仍然不减。

市场方面,结构性行情仍然是市场的主要特征。整体上市公司的盈利受到经济增速低迷的影响,难有亮点;从三季度的工业企业利润以及CPI_PPI的情况来看,全年上市公司的利润很难有较大起色,因为在利润体量的架构上仍旧是银行地产以及传统资源类和制造类企业占大头,而信息技术、医疗服务,高端装备制造等行业虽然增速快但利润体量占比仍是小比例,在流动性逐渐宽松的背景下,估值提升带动了市场的结构性行情,虽然部分公司的估值水平有一定泡沫化的迹象,导致四季度市场波动可能有所加大,但结构性机会仍然存在,受益于改革预期、规模增长较快的新兴行业仍是市场重心所在,四中全会可能在依法治国问题上取得进展,混合所有制改革预计也会在中石化改革的榜样作用下会继续推进,资金利率稳步下降的格局也不会逆转,外延式增长的资本运作也不会戛然而止;所以尽管四季度经济、资本市场的不确定性在上升,基金管理人仍将努力挖掘优质企业,寻找长期投资机会,重点关注信息安全、医疗服务、智慧城市、互联网服务、军工产业、高端装备制造行业的长期发展趋势和技术进步,在控制投资风险、减小组合波动的前提下为基金持有人获取超额收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	33,741,940.51	83.02
	其中:股票	33,741,940.51	83.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,792,766.86	11.79
8	其他各项资产	2,110,768.98	5.19
9	合计	40,645,476.35	100.00

注:由于四舍五入的原因,各比例的分项与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,103,600.00	2.77
C	制造业	21,294,128.11	53.41
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	11,344,212.40	28.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	33,741,940.51	84.64

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

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	000801	四川九洲	110,000	2,348,500.00	5.89
2	300168	万达信息	73,000	2,014,800.00	5.05
3	300170	汉得信息	120,000	1,790,400.00	4.49
4	300173	松德股份	66,000	1,749,000.00	4.39
5	002223	鱼跃医疗	55,000	1,595,000.00	4.00
6	002569	步森股份	62,800	1,560,580.00	3.91
7	300065	海兰信	65,000	1,354,600.00	3.40
8	300188	美亚柏科	33,000	1,268,850.00	3.18
9	002396	星网锐捷	42,000	1,258,740.00	3.16
10	002366	丹甫股份	38,000	1,225,500.00	3.07

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.2 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。

5.11 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 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

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	49,270.85
2	应收证券清算款	2,001,077.78
3	应收股利	-
4	应收利息	1,399.16
5	应收申购款	59,021.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,110,768.98

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

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

报告期期初基金份额总额	40,833,902.09
报告期期间基金总申购份额	5,527,021.32
减:报告期期间基金总赎回份额	11,026,052.67
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	35,334,870.74

§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

本报告期内,基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况,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 影响投资者决策的其他重要信息

2014/07/01 富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行、手机银行费率优惠活动的公告

2014/07/01 富安达基金管理有限公司 2014 年 6 月 30 日基金净值公告

2014/07/18 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金 2014 年第 2 季度报告

2014/08/28 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金 2014 年半年度报告摘要

2014/08/28 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金 2014 年半年度报告

§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

上述各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
二〇一四年十月二十七日

富安达增强收益债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014年10月27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10月24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	富安达增强收益债券型证券投资基金
基金主代码	710301
交易代码	710301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月25日
报告期末基金份额总额	28,775,804.25份
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,采用自上而下的资实达多维经济模型,运用定性与定量分析方法,结合EVA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。
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	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属两级基金的份额总额	13,087,066.44份	15,688,737.81份

§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7月1日-2014年9月30日)	
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
1.本期已实现收益	773,171.25	870,429.97
2.本期利润	999,376.73	1,129,587.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0676	0.0656
4.期末基金资产净值	14,320,171.36	17,003,761.01
5.期末基金份额净值	1.0942	1.0838

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自《公开募集证券投资基金运作管理办法》发布之日起至本季度末,本基金净资产已连续20个工作日低于5000万。

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

富安达增强收益债券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	6.74%	0.35%	2.74%	0.13%	4.00%	0.22%

富安达增强收益债券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	6.63%	0.35%	2.74%	0.13%	3.89%	0.22%

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

注:本基金于2012年7月25日成立。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,建仓截止日为2013年1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。

§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、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理	2012年7月4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

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、《富安达增强收益债券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。本基金投资组合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,按照标准计算周期,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

对政府未来改革预期的憧憬,银行间市场资金价格有序回落,三季度国内资本市场出现了股债双牛领涨全球的新局面,股票整体上涨,中债总财富指数也上行了1.6%,本基金因势利导,适时加大了股票转债的投资仓位,对信用债进行结构调整,保持了中等的杠杆比例,取得了一定的投资效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,富安达增强收益债券A份额净值为1.0942元,C份额净值为1.0838元;本报告期富安达增强收益债券A份额净值增长率为6.74%,C份额净值增长率为6.63%,同期业绩比较基准增长率为2.74%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来中国经济增长中枢缓慢下移,总需求整体疲软,通胀风险不大,货币政策有进一步放松的可能,因此债券市场有望在今年四季度和明年继续慢牛格局。新一届政府加大反腐,提升了市场信心,一系列改革措施的推出有望使股票市场保持较高的活跃度和投资机会。

§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	6,176,368.00	12.87
	其中:股票	6,176,368.00	12.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,054,612.89	79.29
	其中:债券	38,054,612.89	79.29
	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	779,683.87	1.62
8	其他各项资产	2,981,378.48	6.21
9	合计	47,992,043.24	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

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	143,310.00	0.46
B	采矿业	344,000.00	1.10
C	制造业	4,904,952.00	15.66
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	411,138.00	1.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	372,968.00	1.19
S	综合	-	-
	合计	6,176,368.00	19.72

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	601965	中国汽研	68,000	945,200.00	3.02
2	600081	东风科技	37,000	521,700.00	1.67
3	002446	盛路通信	20,000	483,400.00	1.54
4	002008	大族激光	20,000	391,000.00	1.25
5	600088	中视传媒	18,400	372,968.00	1.19
6	601958	金钼股份	40,000	344,000.00	1.10
7	300128	锦富新材	21,600	342,792.00	1.09
8	002701	奥瑞金	15,000	341,850.00	1.09
9	600171	上海贝岭	30,000	341,700.00	1.09
10	000970	中科三环	20,000	324,600.00	1.04

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	1,685,874.90	5.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,106,726.80	16.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,832,000.00	63.31
7	可转债	11,430,011.19	36.49
8	其他	-	-
9	合计	38,054,612.89	121.49

5.5 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	1282490	12川国铁 MTN1	100,000	10,056,000.00	32.10
2	1282487	12博源 MTN1	100,000	9,776,000.00	31.21
3	128005	齐翔转债	30,040	3,532,373.56	11.28
4	110025	国金转债	17,900	2,211,187.00	7.06
5	110027	东方转债	16,220	1,949,481.80	6.22

5.6 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.2 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。

5.11 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 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

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	26,976.40
2	应收证券清算款	1,795,464.53
3	应收股利	-
4	应收利息	1,157,838.19
5	应收申购款	1,099.36
6	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	2,981,378.48

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	110020	南山转债	1,552,638.00	4.96
2	128003	华天转债	689,375.63	2.20
3	110015	石化转债	545,150.00	1.74
4	128001	泰尔转债	200,309.20	0.64

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

	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
本报告期期初基金份额总额	16,998,644.95	20,994,531.60
本报告期基金总申购份额	373,509.27	5,841,747.06
减:本报告期基金总赎回份额	4,285,087.78	11,147,540.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,087,066.44	15,688,737.81

§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

本报告期内,基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况,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 影响投资者决策的其他重要信息

2014/07/01 富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行、手机银行费率优惠活动的公告

2014/07/01 富安达基金管理有限公司 2014 年 6 月 30 日基金净值公告

2014/07/18 富安达增强收益债券型证券投资基金 2014 年第 2 季度报告

2014/08/28 富安达增强收益债券型证券投资基金 2014 年半年度报告摘要

2014/08/28 富安达增强收益债券型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014/09/09 富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一四年第二号)摘要

2014/09/09 富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一四年第二号)

§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

《富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》

《富安达增强收益债券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站(www.fadfunds.com)查阅。

富安达基金管理有限公司
二〇一四年十月二十七日

富安达现金通货币市场证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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:2014年10月27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