富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:2015年10月26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2015年10月23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2015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	138,899,225.87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	在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采用自上而下的富安达多维经济模型,运用定性与定量分析方法,通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率x55%+上证国债指数收益率x45%。
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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-147,009,777.19
2.本期利润	-104,321,131.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6986
4.期末基金资产净值	218,655,903.81
5.期末基金份额净值	1.5742

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

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	-27.04%	3.95%	-15.52%	1.84%	-11.52%	2.11%

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。

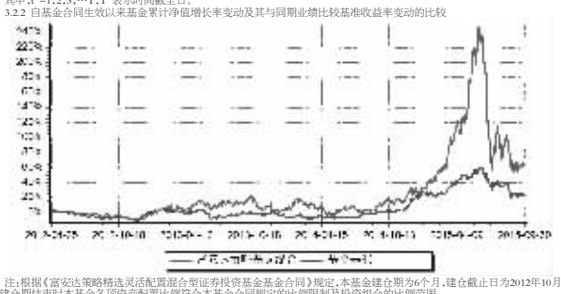
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

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



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。

§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,公司研究发展部总监	2012年4月25日	2015年8月12日	21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
毛矛	本基金的基金经理,公司研究发展部高级行业研究员	2015年5月12日	-	9年	历任中华资源(香港)有限公司交易员;易唯思商务咨询有限公司投资分析师;光大保德信基金管理有限公司行业研究员;富安达基金管理有限公司高级行业研究员兼基金经理助理,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。

3.根据本基金管理人于2015年8月12日发布的《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》,黄强先生不再担任本基金基金经理。

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

回顾三季度,市场在去杠杆的压力下,经历了大幅下跌,上证指数、深成指、创业板指及中小板指跌幅都超过了25%。针对市场在三季度中趋势性震荡下行以及波动较大的特征,我们对大类资产配置做了一些调整,反弹中我们降低了权益类的仓位,适当增加了固定收益的配置,但考虑到债券市场也有一些泡沫迹象,我们的固定收益仓位以短久期正券为主。总体来看,基金净值的波动性已较前期有所降低。

权益类资产的配置方面,出于同样的降低波动性的目的,我们降低了部分波动性较大的中小市值股票的仓位,买入了部分盈利稳定增长、估值处于合理偏低区间的股票,目前整体配置比较均衡。考虑到目前市场仍不稳定,且行业、个股的波动同向性明显,没有出现分化,短期内我们仍将维持均衡配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.5742元,本报告期份额净值增长率为-27.04%,同期业绩比较基准增长率为-15.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年四季度,我们对中国经济增长仍然不能太高的期望,传统三驾马车投资、消费、出口都处于下降趋势中,唯有基建投资可能对经济有一定支撑作用。但从更长期的视角来看,传统经济部门增速下滑带来阵痛并不一定是坏事,其带来的市场化的资源配置调整可以使未来的经济增长更有质量、可持续性更强,当然,这一切都建立在改革政策顺利推进的基础上。

股票市场方面,经过三季度的大幅调整,市场各方面的压力已经大幅降低,虽然宏观经济环境没有明显改善,但考虑到估值及资金面等因素,四季度的市场表现预计应会比三季度好。个股方面,在我们研究团队紧密跟踪的公司中,目前已有部分优质公司的股价进入了价值区间,随着市场逐渐稳定,个股表现也会出现分化,好公司将体现出优势;在此背景下,我们争取发挥研究团队的优势,发掘价值,为持有人带来良好回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	132,295,696.01	59.99
	其中:股票	132,295,696.01	59.99
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	45,000,000.00	20.41
	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	27,726,023.04	12.57
8	其他资产	15,497,120.77	7.03
9	合计	220,518,839.82	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	33,527,709.88	15.33
B	采矿业	-	-
C	制造业	76,684,319.62	35.07
D	电力、热力、燃气及水生产和	-	-
E	建筑业	1,104,000.00	0.50
F	批发和零售业	8,376,621.55	3.83
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	5,957,100.00	2.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	804,000.00	0.37
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	5,835,400.00	2.67
S	综合	6,544.96	-
	合计	132,295,696.01	60.50

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	002299	圣农发展	1,064,006	15,938,809.88	7.29
2	002563	森马服饰	1,166,400	11,745,648.00	5.37
3	002157	正邦科技	650,000	9,561,500.00	4.37
4	000963	华东医药	119,923	8,376,621.55	3.83
5	300189	神农大丰	1,250,000	8,325,000.00	3.81
6	600559	老白干酒	129,000	7,600,680.00	3.48
7	002714	牧原股份	155,000	6,897,500.00	3.15
8	000568	泸州老窖	305,000	6,264,700.00	2.87
9	002250	联化科技	338,000	6,050,200.00	2.77
10	300028	金亚科技	339,041	6,041,710.62	2.76

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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	412,014.71
2	应收证券清算款	15,027,803.48
3	应收股利	-
4	应收利息	14,663.81
5	应收申购款	42,638.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,497,120.77

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300189	神农大丰	8,325,000.00	3.81	拟披露重大事项
2	300028	金亚科技	6,041,710.62	2.76	股价异动暨停牌自查

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	186,224,510.03
报告期期间基金总申购份额	57,715,740.00
减:报告期期间基金总赎回份额	105,041,024.16
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	138,899,225.87

§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	6,365,372.37
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	16,364,372.37
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	11.78

7.2 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	基金转换入	2015年7月10日	6,365,372.37	10,000,000.00	-
合计			6,365,372.37	10,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2015-07-01富安达基金管理有限公司2015年6月30日基金净值公告

2015-07-06富安达基金关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告

2015-07-21富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2015年第2季度报告

2015-08-06富安达基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告

2015-08-12富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告

2015-08-22富安达基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告

2015-08-27富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告(摘要)

2015-08-27富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2015年半年度报告

2015-09-01富安达基金管理有限公司关于参加江苏银行基金定投申购费率优惠推广活动的公告

2015-09-01富安达基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告

2015-09-07关于增加申万宏源西部证券有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

2015-09-18富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2015-09-23富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加利得基金为代销机构及开通定投并参与其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站(www.fadfunds.com)查阅。

富安达基金管理有限公司
二〇一五年十月二十六日

富安达现金通货币市场证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:2015年10月26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2015年10月23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2015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	296,354,789.01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
下属分级基金的基金简称	富安达现金通货币A	富安达现金通货币B
下属分级基金的交易代码	710501	710502
报告期末下属分级基金的份额总额	38,630,119.67份	257,724,669.34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(2015年07月01日-2015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	266,184.16	1,172,856.40
2.本期利润	266,184.16	1,172,856.40
3.期末基金资产净值	38,630,119.67	257,724,669.34

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	0.6699%	0.0069%	0.0883%	0.0000%	0.5816%	0.0069%

2.富安达现金通货币B

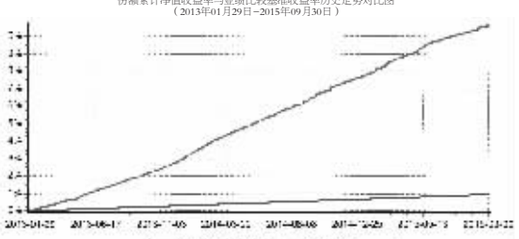
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7311%	0.0069%	0.0883%	0.0000%	0.6428%	0.0069%

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

富安达现金通货币A

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年01月29日-2015年09月30日)

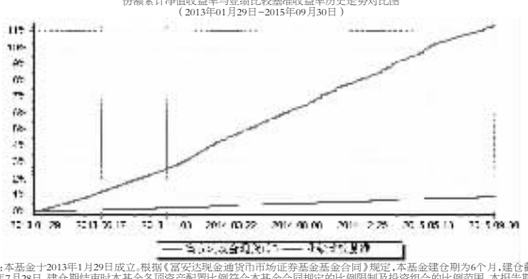


注:本基金于2013年1月29日成立。根据《富安达现金通货币市场证券基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2013年7月28日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。本报告期内,本基金因赎回而被动超标的情况已在规定时间内完成调整。

富安达现金通货币B

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年01月29日-2015年09月30日)



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		
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	-	7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

报告期内债券市场资金面宽松,回购利率和同业存款利率仍维持在历史低位。报告期内通胀回落,经济探底,9月新增外汇占款持续减少。三季度债券供给增加,但并未对债券市场造成明显冲击。央行持续提供流动性,机构风险偏好降低,债券收益率有较大幅度下行。本轮债牛主要依靠货币宽松+资金回流,信用利差先缩小再扩大。报告期内我们主要根据规模变动情况和市场情况对债券资产和回存资产进行了动态调整。

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0.6699%,富安达现金通货币B份额净值收益率为0.7311%,同期业绩比较基准收益率为0.0883%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面,国内需求依然较为疲弱,经济下行压力较大。在宽信用和宽财政的稳增长框架下,如果汇率保持稳定,同时机构的风险偏好低,预计债券收益率会继续下行,信用利差也有进一步扩大空间。同时我们会关注风险资产的表现,股市波动可能会对资金面会产生短期影响,接下来我们将进行短久期、择杠杆操作,防范债券信用风险,警惕低评级产业信用债的估值压力,重点放在债券的调仓上,适时调整组合资产结构。

§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	70,159,690.33	23.40
	其中:债券	70,159,690.33	23.40
	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	226,710,264.62	75.63
4	其他资产	2,905,414.50	0.97
5	合计	299,775,369.45	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	5.05
	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	1,999,877.00	0.67
	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	56
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	52

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	49.51	0.67
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	37.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	6.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	3.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.17	0.67

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

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,159,690.33	23.67
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	70,159,690.33	23.67
10	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	041469061	14中经CP001	100,000	10,056,535.15	3.39
2	041460119	14沪北高新CP002	100,000	10,039,281.10	3.39
3	041562021	15金港CP001	100,000	10,029,610.28	3.38
4	041572002	15镇旅发CP001	100,000	10,023,671.24	3.38
5	041560006	15昌源水务CP001	100,000	10,007,017.01	3.38
6	041476002	14新海连CP001	100,000	10,002,163.40	3.38
7	041460106	14海伦投资CP002	100,000	10,001,412.15	3.37

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	55
报告期内偏离度的最高值	0.4072%
报告期内偏离度的最低值	0.2203%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3264%

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 其他资产构成

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	2,786,378.61
4	应收申购款	119,035.89
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,905,414.50

§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
报告期期初基金份额总额	48,573,209.93	133,005,306.49
报告期基金总申购份额	102,160,967.60	320,907,389.33
减:报告期基金总赎回份额	112,104,057.86	196,188,026.48
报告期末基金份额总额	38,630,119.67	257,724,669.34

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转入及分级份额调增份额;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	基金转换出	2015年07月08日	10,000,000.00	-10,000,000.00	-
2	基金转换出	2015年07月09日	10,000,000.00	-10,000,000.00	-
3	基金转换出	2015年07月10日	10,000,000.00	-10,000,000.00	-
合计			30,000,000.00	30,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2015-07-01富安达基金管理有限公司2015年6月30日基金净值公告

2015-07-06富安达基金关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告

2015-07-21富安达现金通货币市场证券投资基金2015年第2季度报告

2015-08-06富安达基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告

2015-08-22富安达基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告

2015-08-27富安达现金通货币市场证券投资基金2015年半年度报告(摘要)

2015-08-27富安达现金通货币市场证券投资基金2015年半年度报告

2015-09-07关于增加申万宏源西部证券有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

2015-09-11富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书(更新)摘要(二〇一五年第二号)

2015-09-11富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一五年第二号)

2015-09-18富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告

2015-09-23富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加利得基金为代销机构及开通定投并参与其费率优惠活动的公告

2015-09-24关于富安达现金通货币市场证券投资基金2015年国庆假期前暂停大额申购(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》