富安达现金通货币市场证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31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:2016年04月22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2016年4月20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2016年1月1日起至3月31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	445,997,407.38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	23,655,216.24份	422,342,191.14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(2016年01月01日-2016年03月31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	159,122.93	2,397,003.04
2.本期利润	159,122.93	2,397,003.04
3.期末基金资产净值	23,655,216.24	422,342,191.14

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

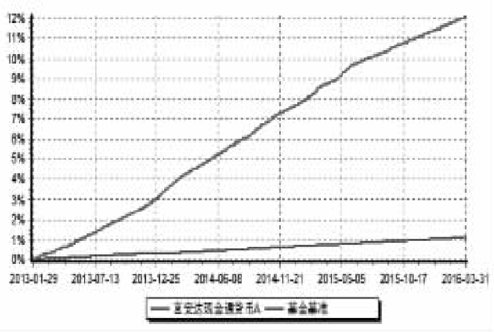
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6354%	0.0041%	0.0873%	0.0000%	0.5481%	0.0041%

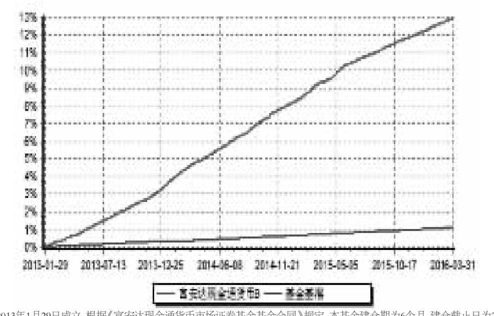
2、富安达现金通货币B

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	0.6956%	0.0041%	0.0873%	0.0000%	0.6083%	0.0041%

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
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年01月29日-2016年03月31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。

§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	-	8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: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》、《公开募集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

报告期内受央行降准影响,除一季度末流动性压力较大外,其余时期流动性整体较为宽裕。受一季度房地产及基建需求阶段性改善影响,3月份PMI指数回暖,房地产市场由年初一线城市的火爆向二、三线城市蔓延。在去产能的大背景下,实体经济应以去库存为首要考虑,预计房地产与基建的阶段性需求改善难以持续。2016年经济下行压力未减缓,改革和结构调整任务仍然繁重。债券市场在持续了较长时间的上涨之后,近期面临较大调整压力。随着信用债违约风险和评级下调事件愈发频繁,信用利差增加,同等级不同行业利差分化持续。近期流动性暂时无忧,短端中高等级品种相对安全。但监管层再次查机构杠杆、地方国企刚兑打破、通胀预期上升,是未来债市主要风险点。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同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0.6354%,富安达现金通货币B份额净值收益率为0.6956%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

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

目前世界经济仍处于调整期,美国经济数据喜忧参半,货币政策信号不确定;欧洲和日本主要经济数据持续不佳;全球货币政策边际宽松且存在分化。国内方面,今年所有的经济目标均出现了下调,经济增长目标设定为6.5%-7%的区间。我们认为货币政策在稳健的同时实际上是偏宽松的,货币政策将为财政政策提供支撑。在信用风险事件频发、债市违约常态化的背景下,我们将谨慎对待弱资质行业中的弱资质企业。随着发行人陆续披露年报,预计本季度会有部分发行人主体及其发行的债券发生跟踪评级调整。我们将严格控制组合久期,坚持中高等级短久期策略,注意防范产能过剩行业和部分民营企业的信用风险,警惕信用债的估值压力。2月1日起货币基金新规施行,尚有部分具体细则仍在明确中,我们接下来将根据新规适时调整组合资产结构,坚持中高等级短久期策略,同时关注其他金融资产及商品资产的走势,防止在通胀预期提升和供给压力下可能带动的收益率小幅上行。

§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	100,183,336.90	19.77
	其中:债券	100,183,336.90	19.77
	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	402,648,529.46	79.45
4	其他资产	3,992,411.91	0.79
5	合计	506,824,278.27	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		6.27
	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	59,899,650.05	13.43
	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	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	69
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

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	63.38	13.43
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	6.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	13.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	29.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	112.75	13.43

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	20,006,808.42	4.49
	其中:政策性金融债	20,006,808.42	4.49
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,176,528.48	17.98
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	100,183,336.90	22.46
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	041575002	15宝塔石化CP001	300,000	30,147,230.78	6.76
2	150411	15农发11	200,000	20,006,808.42	4.49
3	041564031	15华西CP001	100,000	10,030,720.90	2.25
4	041553026	15万达CP001	100,000	10,019,883.16	2.25
5	041562021	15金港CP001	100,000	10,003,840.28	2.24
6	041555019	15复星高科CP001	100,000	9,995,670.24	2.24
7	041553068	15万达CP002	100,000	9,979,183.12	2.24

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2334%
报告期内偏离度的最低值	0.0576%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1338%

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	3,975,754.63
4	应收申购款	16,657.28
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,992,411.91

§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	27,998,078.06	635,660,110.05
报告期基金总申购份额	26,102,638.93	155,507,022.64
减:报告期基金总赎回份额	30,445,500.75	368,824,941.55
报告期期末基金份额总额	23,655,216.24	422,342,191.14

注:报告期期间基金总申报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换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。购份额含红利再投、转换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

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

2016-01-04富安达基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告
2016-01-04富安达基金管理有限公司2015年12月31日基金净值公告
2016-01-07富安达基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告
2016-01-20富安达现金通货币市场证券投资基金2015年第4季度报告
2016-01-22富安达基金管理有限公司关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告
2016-01-30关于富安达现金通货币市场证券投资基金2016年春节前两个工作日暂停申购(含定投及转换转入)业务的公告
2016-02-04富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告
2016-03-08 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限责任公司为代销机构及开通定投并参与其费率优惠活动的公告
2016-03-12富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一六年第一号)
2016-03-12富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一六年第一号)摘要
2016-03-26富安达现金通货币市场证券投资基金2015年年度报告摘要
2016-03-26富安达现金通货币市场证券投资基金2015年年度报告

§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
二〇一六年四月二十二日

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31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:2016年4月22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2016年4月20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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达新兴成长混合
基金主代码	000755
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月11日
报告期末基金份额总额	44,641,960.21份
投资目标	本基金通过股票与债券等资产的合理配置,通过深入研究并积极投资于新兴产业及其相关行业中的高速成长企业,分享新兴产业发展所带来的投资机会,在有效控制风险的前提下,力争为投资者带来长期的超额收益。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型,通过对全球经济发展形势,国内经济情况及经济政策、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,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测,并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型,辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。一般情况下,本基金将大部分基金资产投资于新兴产业及其相关行业中成长型上市公司所发行的股票等证券,当证券市场系统性风险加大时,本基金将降低相关证券资产的配置比例。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况,其风险和预期收益低于股票型基金,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(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-8,104,431.48
2.本期利润	-7,310,925.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0414
4.期末基金资产净值	59,076,580.62
5.期末基金份额净值	1.3233

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	1.49%	2.55%	-9.98%	1.79%	11.47%	0.76%

注:①本基金业绩比较基准为:60%×中证新兴产业指数+40%×中债总指数,

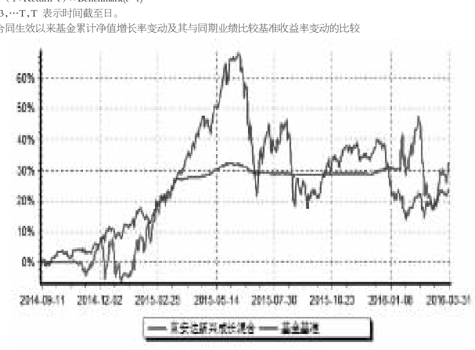
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =60%×[中证新兴产业指数t / 中证新兴产业指数(t-1)-1]+40%×[中债总指数t / 中债总指数(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



注:本基金于2014年9月11日成立,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2015年3月10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		
孙绍冰	本基金的基金经理、公司研究发展部总监助理	2015年5月22日	-	9年	历任齐鲁证券研究所行业研究员,富安达基金管理有限公司研究发展部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。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达新兴成长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

受人民币贬值预期、注册制改革预期等因素影响,而熔断机制又加剧了市场恐慌,年初到2月底,资本市场深度调整。进入3月份,随着利空因素的逐步消退,年初

政策规划亮点不断、流动性宽松的特征不变、汇率波动在可控范围内,市场进入修复期。

投资策略方面:我们依然积极布局战略新兴产业,在市场深度调整阶段,我们一方面对仓位进行了严格控制;另一方面,我们适当加大了安全边际较高的行业以及个股的配置;后期,随着市场企稳反弹,我们在保持恰当仓位的前提下,提高了对长期看好标的的配置。通过努力,希望在减少净值回撤风险的前提下,在市场波动中完成仓位调整,为后续的行情做好准备。

行业配置方面,我们认为能够穿越周期的更多是代表未来经济发展方向的战略新兴产业,与此有关的信息技术、智能制造、生物医药、新能源汽车以及环保等行业将进行重点配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2016年3月31日,本基金份额净值为1.3233元,本报告期份额净值增长率为1.49%,同期业绩比较基准增长率为-9.98%。

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

宏观经济方面:一方面国内经济需求乏力,供给侧改革进入攻坚阶段;另一方面国外经济增长乏力,外需不足。从基本面看,预计未来一段时间宏观经济将呈现L型弱平衡的运行态势。但从微观企业的表现看,在经济转型背景下,尽管宏观增长动力不足,但结构性的增长亮点也会层出不穷。

流动性方面:为改革和转型赢得时间,"稳增长"仍不可或缺,预计整体流动性依然宽松,但2016年经济形势更为复杂,外有美国加息预期,内有供给侧改革推进,因而边际改善可能要弱于2015年。

在对整体宏观经济基本面以及流动性判断的基础上,我们认为2016年市场将会维持震荡走势,结构性机会仍会延续,改革与创新预计将会有较好的市场表现,业绩和成长空间仍将是筛选股票的主要标准,而估值标准依然需要兼顾。年初以来资本市场剧烈波动是多重因素(人民币贬值、注册制预期、熔断机制加剧市场恐慌……)叠加的结果,随着利空因素的逐步消除,我们认为市场逐步进入行情修复阶段。我们将重点关注战略新兴产业的投资机会,主要包括信息技术、健康经济、智能装备、新能源汽车等。

本基金将在市场分化过程中发挥"自下而上"精选个股的优势,配合适时的仓位控制,力争为投资者带来较好的投资回报。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	55,066,978.17	90.70
	其中:股票	55,066,978.17	90.70
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	4,903,332.45	8.08
8	其他资产	743,774.98	1.23
9	合计	60,714,085.60	100.00

注: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	684,400.00	1.16
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,956,508.12	45.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,715,984.95	14.75
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	16,684,485.10	28.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,025,600.00	3.43
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	55,066,978.17	93.21

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	002781	奇信股份	204,545	6,772,484.95	11.46
2	300488	恒锋工具	71,341	5,159,381.12	8.73
3	300100	双林股份	55,000	2,133,450.00	3.61
4	600730	中国高科	120,000	2,025,600.00	3.43
5	002717	岭南园林	50,000	1,943,500.00	3.29
6	300297	蓝盾股份	115,000	1,914,750.00	3.24
7	002355	兴民钢圈	90,000	1,892,700.00	3.20
8	002284	亚太股份	95,000	1,886,700.00	3.19
9	600446	金证股份	50,000	1,850,500.00	3.13
10	002273	水晶光电	50,000	1,794,500.00	3.04

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债券。

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。

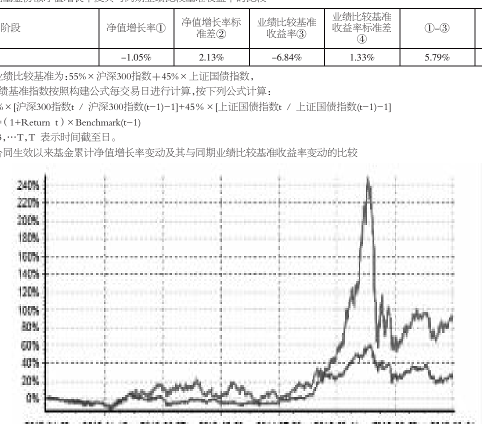
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31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:2016年4月22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2016年4月20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