富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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.基金托管人中国农业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2016年3月31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	
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	13,814,580.86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.本基金主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,在两市场之间轮动过换,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	
下属分级基金的基金简称	富安达信用主题A	富安达信用主题C
下属分级基金的交易代码	000284	000285
报告期末下属分级基金的份额总额	12,128,851.32份	1,685,729.54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)	
	富安达信用主题A	富安达信用主题C
1.本期已实现收益	-1,315,922.57	-218,615.96
2.本期利润	-1,755,805.66	-279,962.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1448	-0.1424
4.期末基金资产净值	14,296,377.80	1,965,996.02
5.期末基金份额净值	1.1787	1.1663

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

富安达信用主题A

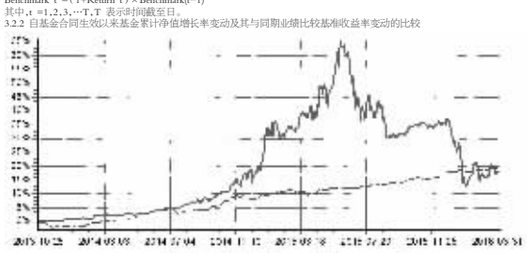
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.89%	1.21%	1.10%	0.10%	-11.99%	1.11%

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	-10.98%	1.21%	1.10%	0.10%	-12.08%	1.11%

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2013年10月25日成立,根据《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》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2014年4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。

注:本基金于2013年10月25日成立,根据《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》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2014年4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、富安达增强收益债券型证券投资基金基金经理、公司固定收益部副总监(主持工作),投资管理部总监助理(主持工作)	2013年10月25日		13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、富安达现金通货市场证券投资基金基金经理	2013年10月25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: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产格遵守《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》。

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 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,富安达信用纯债债券发起式A份额净值为1.1787元,C份额净值为1.1663元;富安达信用纯债债券发起式A份额净值增长率为-10.89%,C份额净值增长率为-10.98%,同期业绩比较基准增长率为1.10%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年3月31日,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》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2014年4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。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金,截止3月31日规模低于5000万,基金运作未满三年,不适用《开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内宏观金融数据超预期强劲,美联储也放缓加息节奏,欧日货币当局竞相放水,人民币汇价逐步企稳,信贷和广义货币高速增长打消了经济失速的顾虑。目前债券收益率均处于历史低位,配置价值存在,但净价收益有限。随着我国4月制造业PMI再度进入扩张区间,地产新开工回温,实体经济出现了触底回升的迹象。随着供给侧产能结构性改革的落实,过剩产能有望控制引导,债转股则另辟蹊径,将提升直接融资比例并且降低杠杆率,注册制的放缓和战新板的搁置也将提升投资者的风险偏好,因此未来股债收益或将在各自多空因素的影响下进入新的均衡。

§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	25,706,472.40	94.98
	其中:债券	25,706,472.40	94.98
	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	1,109,458.47	4.10
8	其他资产	248,232.77	0.92
9	合计	27,064,163.64	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	1,050,258.80	6.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,833,840.00	35.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据		-
7	可转债	18,822,373.60	115.74
8	其他	-	-
9	合计	25,706,472.40	158.07

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	113008	电气转债	23,020	2,735,236.40	16.82
2	113009	广汽转债	20,000	2,395,400.00	14.73
3	132004	15国盛EB	23,920	2,391,760.80	14.71
4	110031	航信转债	15,880	2,061,859.20	12.68
5	128009	歌尔转债	16,100	2,040,192.00	12.55

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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,531.60
2	应收证券清算款	98,741.14
3	应收股利	-
4	应收利息	128,230.80
5	应收申购款	8,729.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	248,232.77

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	113008	电气转债	2,735,236.40	16.82
2	110031	航信转债	2,061,859.20	12.68
3	128009	歌尔转债	2,040,192.00	12.55
4	110030	格力转债	1,974,624.00	12.14

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

§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
报告期期初基金份额总额	12,531,290.04	1,863,166.62
报告期期间基金总申购份额	667,519.68	829,264.65
减:报告期期间基金总赎回份额	1,069,958.40	1,006,701.73
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	12,128,851.32	1,685,729.54

§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 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	72.38%	9,999,000.00	72.38%	三年
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 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富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金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
2016-02-04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
2016-03-17富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券有限责任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
2016-03-26富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠的公告
2016-03-26富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金2015年年度报告摘要
2016-03-26富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金2015年年度报告

§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
二O一六年四月二十二日

富安达优势成长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	富安达优势成长混合
基金主代码	710001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月21日
报告期末基金份额总额	1,069,061,120.90份
投资目标	本基金定位为混合型证券投资基金.在充分控制风险的前提下,精选具有竞争优势及持续成长性的上市公司,分享中国经济高速发展带来的收益,力争获得超越投资基准的收益。
投资策略	本基金采用自上而下的多维经济模型,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信息的分析,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,并根据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,同时将定性分析与定量分析贯穿于行业配置和个股选择的投资全过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
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	-431,717,540.98
2.本期利润	-582,669,185.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5331
4.期末基金资产净值	1,835,623,797.83
5.期末基金份额净值	1.717

注: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。

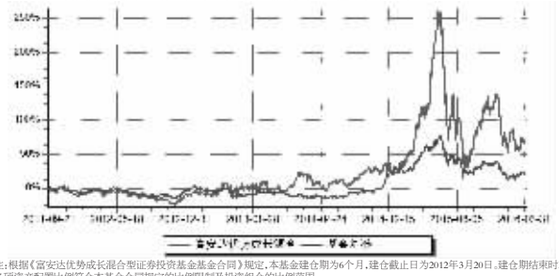
3.2 基金净值表现

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	-23.55%	3.67%	-9.89%	1.82%	-13.66%	1.85%

注:注:①本基金业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×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 =75%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+25%×[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《富安达优势成长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3月20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		
孔学兵	本基金的基金经理、公司投资管理部总监、富安达基金管理有限公司董事	2011年9月21日	2016年1月29日	20年	历任南京证券股份有限公司证券投资总部投资经理;资产管理总部投资主办、硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍
吴战峰	本基金的基金经理、公司研究发展部总监	2016年1月9日	-	21年	历任中大投资公司投资部经理、平安证券资产管理部投资经理、招商证券研发中心高级分析师;国信证券研究所首席分析师、国投瑞银基金高级组合经理、国泰基金基金经理、天治基金基金经理、总经理助理兼研究总监,具有基金从业资格,中国国籍。

注:注:1.任职日期和离任日期均指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,任职日期为基金合同生效日。
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产格遵守《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、《富安达优势成长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 报告期内基金的业绩表现
截至2016年3月31日,富安达优势成长混合A份额净值为1.7170元,本报告期份额净值增长率为-23.55%,同期业绩比较基准增长率为-9.89%。
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2016年,我们认为虽然国内经济依然处于巨大的结构调整过程中,美国处于加息周期,人民币面临贬值压力,无风险收益率难以进一步下行,投资者风险偏好依然较低,这些因素将对市场形成较大的上行压力,但政府推出的稳汇率、促进经济结构稳步调整的政策正在发挥积极的作用,信息产业、现代服务业、大健康产业依然呈现勃勃生机,因此,我们认为市场将可能呈现较宽幅的震荡局面,依然有较好的结构性机会,我们的投资方向主要在新兴成长行业中有巨大成长空间、有很强竞争优势的公司,另外我们也同时关注在传统产业中,经过市场竞争胜出的依然保持较高增长和盈利能力的优势企业。

§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	1,690,659,587.11	91.35
	其中:股票	1,690,659,587.11	91.35
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	113,475,749.85	6.13
8	其他资产	46,633,548.28	2.52
9	合计	1,850,768,885.24	100.00

注: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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,770,089.80	1.02
B	采矿业	43,761,979.50	2.38
C	制造业	676,262,840.14	36.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	37,611,773.32	2.05
F	批发和零售业	6,215,000.00	0.34
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	594,185,852.98	32.37
J	金融业	45,688,942.54	2.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	57,543,900.00	3.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,125,900.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	154,968,369.83	8.44
R	文化、体育和娱乐业	54,524,939.00	2.97
S	综合	-	-
	合计	1,690,659,587.11	92.10

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	600571	信雅达	2,000,000	93,700,000.00	5.10
2	300347	泰格医药	2,633,482	72,262,746.08	3.94
3	002439	启明星辰	2,832,098	67,007,438.68	3.65
4	300113	顺网科技	722,000	64,041,400.00	3.49
5	600570	恒生电子	937,400	54,687,916.00	2.98
6	300017	网宿科技	919,998	53,737,083.18	2.93
7	300059	东方财富	1,200,000	53,160,000.00	2.90
8	002280	联络互动	1,999,872	50,596,761.60	2.76
9	002294	信立泰	1,757,361	49,715,742.69	2.71
10	300367	东方网力	1,589,856	48,538,303.68	2.64

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
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,基金投资的前十名证券的发行主体除恒生电子(600570)外,没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年内除信雅达(600571)、恒生电子(600570)外,没有受到公开谴责、处罚。
2015年9月18日,信雅达(600571)因拒绝向反垄断执法机构提供有关材料被安徽省工商局以皖工商公处字[2015]2号《行政处罚决定书》处以责令当事人立即改正、罚款二十万元(小写200000.00元)的处罚。信雅达已就上述违法行为缴纳了罚款并积极进行了整改,不影响公司正常生产经营。
2015年8月19日恒生电子公告公司控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(沪证专调查字2015356号),因恒生网络涉嫌违反证券、期货法律法规,根据《中华人民共和国证券法》、《期货交易管理条例》的有关规定,中国证券监督管理委员会决定对恒生网络进行立案调查。2015年9月7日,恒生电子股份有限公司收到公司控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司(以下简称"恒生网络")的通知,恒生网络并刘剑峰先生、岳晓岚先生于2015年9月7日收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书(处罚字[2015]68号)。
在本基金对该证券的投资过程中,本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下,经公司审慎研究评估,将信雅达(600571)、恒生电子(600570)纳入投资库进行投资,整个过程中严格履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。
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	596,636.70
2	应收证券清算款	43,203,829.67
3	应收股利	-
4	应收利息	60,468.61
5	应收申购款	2,772,613.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,633,548.28

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	600571	信雅达	93,700,000.00	5.10	重大资产重组
2	002439	启明星辰	67,007,438.68	3.65	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,094,086,338.54
报告期期间基金总申购份额	269,562,831.13
减:报告期期间基金总赎回份额	294,588,048.77
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	1,069,061,120.90

§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	27,589,690.27
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	27,589,690.27
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.58

注: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

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
2016-01-09富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理更变公告
2016-01-20富安达优势成长混合型证券投资基金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富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理更变公告
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
2016-03-17富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券有限责任公司

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
2016-03-26富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠的公告
2016-03-26富安达优势成长混合型证券投资基金(原优势成长股票型基金转型)2015年年度报告摘要
2016-03-26 富安达优势成长混合型证券投资基金(原优势成长股票型基金转型)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优势成长混合型证券投资基金设立的文件
《富安达优势成长混合型证券投资基金招募说明书》
《富安达优势成长混合型证券投资基金基金合同》
《富安达优势成长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O一六年四月二十二日

富安达增强收益债券型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2