富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月20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7月18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04月01日起至6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	104,059,588.93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×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(2016年4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-2,598,872.16
2.本期利润	9,533,913.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0899
4.期末基金资产净值	203,152,772.78
5.期末基金份额净值	1.9523

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	4.86%	1.04%	-0.73%	0.55%	5.59%	0.49%

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。

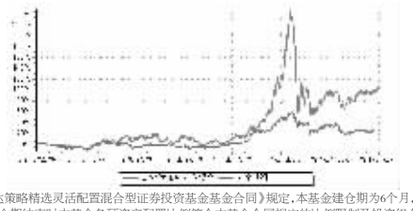
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

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		
毛矛	本基金的基金经理,富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,公司研究发展部高级行业研究员	2015年5月12日	-	10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高级行业研究员;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。

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》。

截止报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异,未发现公平交易异常情形。

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

回顾二季度,市场整体波动不大,沪深300下跌1.99%、创业板指下跌0.47%;但结构上差异巨大,部分子行业或主题板块,如新能源汽车、白酒、OLED、涨幅超过30%,同时也有部分板块下跌超过30%。大类资产配置方面,二季度的变化不大,权益类的仓位比较稳定。固定收益方面,我们的配置仍以回购等短久期投资标的为主;此外,在二季度债券市场逢约频出导致市场略显恐慌的环境下,我们也配置了部分确定性较高的公司债。权益类配置方面,我们的配置以估值合理、同时基本面趋势良好的行业、公司为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2016年6月30日,本基金份额净值为1.9523元,本报告期份额净值增长率为4.86%,同期业绩比较基准增长率为-0.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§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	137,238,091.10	66.86
	其中:股票	137,238,091.10	66.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,558,766.70	5.63
	其中:债券	11,558,766.70	5.63
	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	41,000,000.00	19.97
	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	12,143,432.25	5.92
8	其他资产	3,317,842.74	1.62
9	合计	205,258,132.79	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	21,720,897.88	10.69
B	采矿业	1,548,000.00	0.76
C	制造业	100,007,173.77	49.23
D	电力、热力、燃气及水生产和	1,959,385.45	0.96
E	建筑业	1,146,019.00	0.56
F	批发和零售业	6,224,230.00	3.06
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	3,225,990.00	1.59
J	金融业	1,019,371.00	0.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	387,024.00	0.19
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	137,238,091.10	67.55

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	607,894	15,744,454.60	7.75
2	000858	五粮液	170,000	5,530,100.00	2.72
3	002048	宁波华翔	197,200	4,509,964.00	2.22
4	002007	华兰生物	131,589	4,131,894.60	2.03
5	002563	森马服饰	360,000	3,898,800.00	1.92
6	000963	华东医药	50,000	3,370,000.00	1.66
7	000651	格力电器	175,000	3,363,500.00	1.66
8	002746	仙坛股份	79,500	3,313,560.00	1.63
9	603328	依顿电子	108,000	3,190,320.00	1.57
10	600521	华海药业	127,084	3,090,682.88	1.52

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	公允价值(元)	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	11,538,766.70	5.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	20,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,558,766.70	5.69

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112155	12正邦债	84,890	8,321,766.70	4.10
2	122983	11天威债	32,170	3,217,000.00	1.58
3	127003	海印转债	200	20,000.00	0.01

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	167,725.44
2	应收证券清算款	2,848,921.36
3	应收股利	-
4	应收利息	279,547.50
5	应收申购款	21,648.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,317,842.74

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	000651	格力电器	3,363,500.00	1.66	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期初基金份额总额	106,972,404.20
报告期间基金总申购份额	3,333,084.12
减:报告期间基金总赎回份额	6,245,899.39
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	104,059,588.93

§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

报告期初管理人持有的本基金份额	16,364,372.37
报告期间买入/申购总份额	-
报告期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	16,364,372.37
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	15.73

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

1.2016年4月1日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票恒锋工具(300488)估值调整的公告;

2.2016年4月11日,富安达基金管理有限公司关于参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告;

3.2016年4月11日,富安达基金管理有限公司关于参加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告;

4.2016年4月11日,富安达基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告;

5.2016年4月16日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构及开通定投和转换业务的公告;

6.2016年4月22日,富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告;

7.2016年4月22日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票启明星辰(002439)估值调整的公告;

8.2016年5月11日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票恒大高新(002591)估值调整的公告;

9.2016年5月11日,富安达基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告;

10.2016年6月6日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构及开通定投和转换业务的公告;

11.2016年6月8日,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(更新)(二〇一六年第一号);

12.2016年6月8日,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(更新)(二〇一六年第一号)摘要;

13.2016年6月18日,富安达基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.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》。

2.《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

3.基金管理人业务资格批件和营业执照;

4.基金托管人业务资格批件和营业执照;

5.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;

6.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
二〇一六年七月二十日

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月20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7月18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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达健康人生混合
基金主代码	001861
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月25日
报告期末基金份额总额	269,474,108.90份
投资目标	本基金通过资产的灵活配置,重点投资于能够满足人们对优质健康生活需求的上市公司,在有效控制风险的前提下,力争为投资者带来长期稳定的超额收益。
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做出预测,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健康人生主题下的上市公司证券,当证券市场系统性风险加大时,本基金将对相关证券资产的配置比例做出适时调整。
业绩比较基准	沪深300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4月1日-2016年6月30日)
1.本期已实现收益	1,509,053.27
2.本期利润	6,650,849.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0239
4.期末基金资产净值	268,663,351.11
5.期末基金份额净值	0.997

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	2.27%	0.93%	-1.03%	0.61%	3.30%	0.32%

注:①本基金业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×中债总财富总指数。

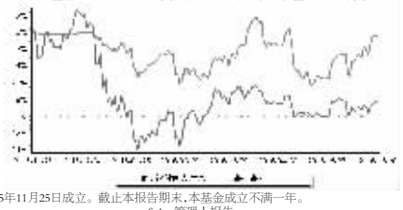
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =60%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+40%×[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2015年11月25日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

§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		
毛矛	本基金的基金经理,富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,公司研究发展部高级行业研究员	2015年11月25日	-	10年	历任中华资源贸易有限公司交易员;易唯思商务咨询有限公司分析师;光大保德信基金管理有限公司研究员。硕士研究生,具有基金从业资格。中国国籍。
李守峰	本基金的基金经理,公司研究发展部行业研究员	2015年12月25日	-	6年	历任万联证券研究所医药研究员。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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达健康人生灵活配置混合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》。

截止报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异,未发现公平交易异常情形。

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

在经过一季度的快速杀跌后,二季度A股整体开始企稳并呈现分化的格局,以总市值加权平均法计算二季度上证A股下跌了1.65%,深证A股上涨2.86%,中小板上涨3.64%,创业板上涨6.77%。细分行业看A股二季度也是存在结构性的机会,一类机会是以食品饮料、家电为代表的价值类股票表现突出,板块分别上涨了10.5%和6.98%,茅台、五粮液、美的集团等创出了历史新高或接近历史新高,为投资者带来了绝对收益;另一类机会是以电子(半导体)、新能源汽车为代表的新兴产业表现同样也是突出,其中电子板块二季度涨幅为12.62%,这些细分子行业符合未来的发展方向,尽管经济低迷也保有较高的景气度,同样为投资者带来了绝对收益。由于市场在二季度企稳,我们逐步加大了股票仓位的配置;在具体标的上,我们将配置的重点放在了估值已经具备安全边际的医药类个股上。二季度总体看由于仓位控制的原因,本基金回撤较小,但由于医药股景气度较前几年有所下滑,基金在弹性上略有不足。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,本报告期富安达健康人生灵活配置混合份额净值为0.9970元,净值增长率为2.27%,同期业绩比较基准增长率为-1.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§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	197,013,161.21	71.16
	其中:股票	197,013,161.21	71.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	120,000.00	0.04
	其中:债券	120,000.00	0.04
	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	30,000,000.00	10.84
	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	49,509,723.64	17.88
8	其他资产	211,472.71	0.08
9	合计	276,854,357.56	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,930,800.00	1.46
C	制造业	114,795,348.76	42.73
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	21,117,132.00	7.86
G	交通运输、仓储和邮政业	18,924,286.08	7.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,397,107.80	3.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	24,535,086.57	9.13
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	4,313,400.00	1.61
	合计	197,013,161.21	73.33

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	000886	海南高速	1,880,000	12,088,400.00	4.50
2	000790	华神集团	823,600	9,314,916.00	3.47
3	002553	南方轴承	635,596	8,955,547.64	3.33
4	600729	重庆百货	340,800	8,451,840.00	3.15
5	002370	亚太药业	260,000	7,670,000.00	2.85
6	002332	仙琚制药	602,467	6,747,630.40	2.51
7	600896	中海海盛	639,902	6,744,567.08	2.51
8	000705	浙江震元	476,600	6,715,294.00	2.50
9	600240	华业资本	670,000	6,713,400.00	2.50
10	002578	闽发铝业	711,057	6,705,267.51	2.50

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	公允价值(元)	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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	120,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	120,000.00	0.04

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	127003	海印转债	1,200	120,000.00	0.04

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	186,644.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,431.73
5	应收申购款	396.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	211,472.71

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	600896	中海海盛	6,744,567.08	2.51	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	297,841,701.15
报告期间基金总申购份额	867,682.52
减:报告期间基金总赎回份额	29,235,274.77
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	269,474,108.90

§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	9,999,000.00
报告期间买入/申购总份额	-
报告期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.71

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

1.2016年4月1日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票恒锋工具(300488)估值调整的公告;

2.2016年4月11日,富安达基金管理有限公司关于参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告;

3.2016年4月11日,富安达基金管理有限公司关于参加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告;

4.2016年4月11日,富安达基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告;

5.2016年4月16日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构及开通定投和转换业务的公告;

6.2016年4月22日,富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告;

7.2016年4月22日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票 启明星辰(002439)估值调整的公告;

8.2016年5月11日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票 恒大高新(002591)估值调整的公告;

9.2016年5月11日,富安达基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司 兼任职务及领薪情况的公告;

10.2016年6月6日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构及开通定投和转换业务的公告;

11.2016年6月18日,富安达基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金设立的文件:

《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

2.《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

3.基金管理人业务资格批件和营业执照;

4.基金托管人业务资格批件和营业执照;

5.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;

6.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
二〇一六年七月二十日

富安达现金通货币市场证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年07月20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7月18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4月1日起至6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