东兴改革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:东兴证券股份有限公司
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7月20日

§1 重要提示及目录

1.1 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7月15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2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东兴改革精选混合
基金主代码	001708
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月8日
报告期末基金份额总额	95,457,373.74份
投资目标	本基金主要投资受益于全面深化改革的行业股票,精选其中具有竞争优势和估值优势的上市公司,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以中国全面深化改革过程中产生的各类投资机遇作为主线,并通过"自上而下"和"自下而上"相结合的方法构建基金资产组合。一方面,本基金在对国内外宏观经济发展趋势、相关改革政策深入研究的基础上,从"自上而下"的角度对大类资产进行优配置,并优选受益行业;另一方面,本基金从商业模式、市场前景、竞争壁垒、财务状况等方面出发,"自下而上"精选受益改革相关证券中具有竞争优势和估值优势的优质上市公司,力求在严格控制风险的前提下,获取长期持续稳健的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高风险水平的投资品种。
基金管理人	东兴证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	-4,921,449.46
2.本期利润	-3,144,036.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0325
4.期末基金资产净值	82,566,958.95
5.期末基金份额净值	0.865

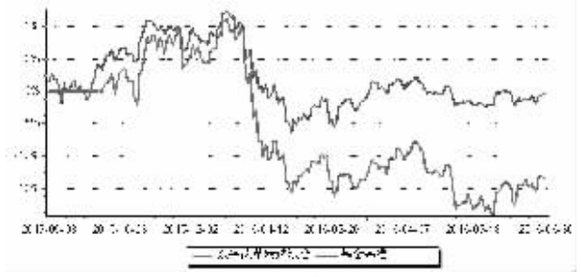
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-3.57%	1.42%	-1.40%	0.61%	-2.17%	0.81%

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



§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		
孙继青先生	本基金基金经理	2015年9月8日	-	8年	北京科技大学工学硕士,3年钢铁行业经验,8年证券行业经验。2007年10月加入东兴证券,2007年10月至2012年3月任东兴证券研究所钢铁行业研究员;2012年3月至2013年6月任东兴证券资产管理部投资总行业研究员、宏观策略研究员;2013年6月至2014年9月任东兴证券资产管理部投资经理。2014年9月加入东兴证券基金业务部。现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴安盈宝货币市场基金基金经理。
刘家伟先生	本基金基金经理	2015年12月25日	-	18年	经济学博士,从事证券行业18年以上,曾任大通证券研发中心副总经理。2007年入职东兴证券股份有限公司研究所,从事天力研究、曾任造纸、农业、食品饮料行业分析师,历任食品饮料首席分析师、消费组组长、研究所副所长、研究总监等。现任职基金业务副投资研究团队。现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的聘任日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。
本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度初,房地产成交、经济预期和信贷预期较好,市场延续3月份的强势,但随着4、5月份经济和信贷数据公布后,经济复苏力度明显减弱,加上房地产成交下滑、人民币贬值、英国脱欧、政策监管收紧等影响下,市场出现了较大调整。在各种利空逐步消化后,6月份市场小幅反弹,报告期内,上证综指、沪深300和创业板指数涨幅分别为-2.47%、-1.99%和-0.47%。
报告期内,根据市场情况,在6月份反弹过程中抓住机会,当月净值增长2.58%,主要投资领域以白酒、家电、军工、智能汽车、电子为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年4月1日起至2016年6月30日,本基金份额净值增长率为-3.57%,业绩比较基准收益率为-1.40%,低于业绩比较基准2.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,从国际环境来看,英国脱欧造成的短期冲击逐步消化,英国加息预期强化,国际经济层面的利空逐步消化。从国内来看,我们认为经济仍然处于L型,供给侧改革仍然是主旋律。市场经历了上半年的调整之后,估值处于相对合理的水平,加上短期利空也逐步消化,市场将迎来较好的反弹窗口。我们认为三季度应主要以下几个方向:一是受益于避险、天气、供给收缩等因素价格上涨的相关品种;二是国企及军工改革;三是国内外联动的新能源产业、新材料、新技术、新应用等领域。
风险提示:第三季度乃至整个下半年全球和国内形势依然异常复杂、地缘政治摩擦加剧风险,国内人民币汇率预期变化和通胀预期变化带来的货币政策的变化,可能会导致市场波动比较频繁。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	68,546,365.80	82.42
	其中:股票	68,546,365.80	82.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,997,600.00	4.81
	其中:债券	3,997,600.00	4.81
	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	10,481,375.31	12.60
8	其他资产	139,913.72	0.17
9	合计	83,165,254.83	100.00

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	-	-
C	制造业	49,807,700.00	60.32
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	3,903,265.80	4.73
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	4,216,000.00	5.11
J	金融业	10,619,400.00	12.86
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	68,546,365.80	83.02

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	600519	贵州茅台	15,000	4,378,800.00	5.30
2	000858	五粮液	130,000	4,228,900.00	5.12
3	000028	国药一致	59,958	3,903,265.80	4.73
4	002179	中航光电	90,000	3,898,800.00	4.72
5	002142	宁波银行	250,000	3,695,000.00	4.48
6	000728	国元证券	220,000	3,678,400.00	4.46
7	600563	法拉电子	80,000	3,641,600.00	4.41
8	002049	紫光国芯	80,000	3,516,000.00	4.26
9	600038	中直股份	80,000	3,318,400.00	4.02
10	600418	江淮汽车	260,000	3,296,800.00	3.99

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	3,997,600.00	4.84
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	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,997,600.00	4.84

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	019533	16国债05	30,000	2,998,200.00	3.63
2	019539	16国债11	10,000	999,400.00	1.21
3				-	-
4				-	-
5				-	-

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
本基金本报告期内未投资股指期货。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
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
本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。
5.11.2
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
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	107,810.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,103.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	139,913.72

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	000728	国元证券	3,678,400.00	4.46	拟披露重大信息停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	97,839,786.95
报告期期间基金总申购份额	358,822.71
减:报告期期间基金总赎回份额	2,741,235.92
报告期期间基金分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	95,457,373.74

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	17,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
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	17,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	18.86

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同
2、东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议
3、东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金2016年第2季度报告原文
8.2 存放地点
北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层
8.3 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.fund.dxzq.net)查阅。

东兴证券股份有限公司
二〇一六年七月二十日

富安达增强收益债券型证券投资基金

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	富安达增强收益债券
基金主代码	710301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年07月25日
报告期末基金份额总额	39,306,992.55份
投资目标	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"的富安达多维经济模型,运用定性与定量分析方法,结合PEM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
下属分级基金的基金简称	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属分级基金的份额总额	13,205,120.89份	26,101,871.66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04月01日-2016年06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	293,426.19	150,920.78
2.本期利润	-50,510.92	-250,271.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0036	-0.0093
4.期末基金资产净值	16,099,895.23	31,294,043.13
5.期末基金份额净值	1.2192	1.1989

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

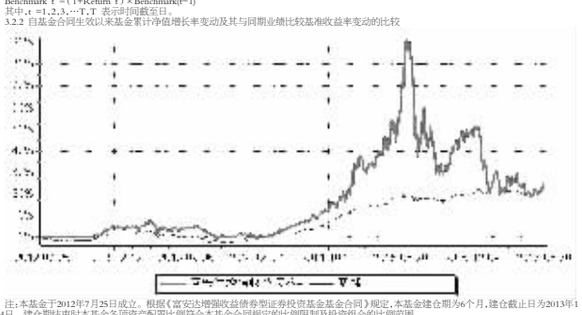
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.97%	0.85%	0.04%	0.13%	-1.01%	0.72%

富安达增强收益债券C

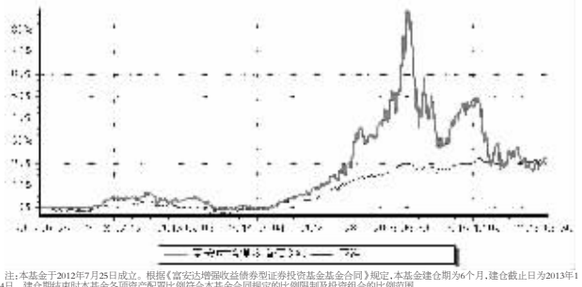
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.08%	0.85%	0.04%	0.13%	-1.12%	0.72%

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造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



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。



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,富安达信用主题精选纯债债券型发起式证券投资基金基金经理,富安达长盈保本混合型证券投资基金基金经理,公司固定收益部总监(任投工作)及投资管理部总监助理(任投工作)	2013年07月04日		13年	历任上海技术应用技术学院财政经济系教师;数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分析师;博时基金管理有限公司投资研究总监、交易部总监;博时基金管理有限公司投资决策委员会委员、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,则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》。
截止报告日,公司记录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

报告期内中国经济表现总体平稳,通胀水平显有起伏,但总体依旧可控。国内结构性矛盾突显,政府加大了企业债务清理,削减过剩产能,美国脱欧,海外市场波动加大,人民币再度加速贬值。监管政策上则显著从严,金融反腐,倒逼资金脱虚向实。股指低位震荡整理,但主题性和结构性投资机会较多。债市则高位盘整,但信贷和M2的反弹,债市供给扩增,二季度利率债收益率震荡上行。债券连续的事件较多,造成过剩产能行业债券收益率一路走高,信用风险显著恶化,利差有走所走阔。二季度本基金债券组合保持适当杠杆,降低了组合久期,对波动性较高的股票和转债做了相应的交易性操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,富安达增强收益债券A份额净值为1.2192元,C份额净值为1.1989元;本报告期富安达增强收益债券A份额净值增长率为-0.97%,C份额净值增长率为-1.08%,同期业绩比较基准增长率为0.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2016年4月20日至2016年6月30日共计连续50个工作日基金净值低于5000万。

§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	77,722,373.88	83.86
	其中:债券	77,722,373.88	83.86
	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	4,486,150.95	4.84
8	其他资产	1,146,904.15	1.24
9	合计	92,681,854.98	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

金额单位:人民币元

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,226,088.00	15.25
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	1,522,988.00	3.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	577,350.00	1.22
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	9,326,426.00	19.68

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	300121	阳谷华泰	100,700	1,378,583.00	2.91
2	002370	亚太药业	45,700	1,348,150.00	2.84
3	300050	世纪瑞尔	56,400	811,596.00	1.71
4	300479	神思电子	18,000	771,660.00	1.63
5	002454	松芝股份	40,000	727,200.00	1.53
6	300271	华宇软件	37,600	711,392.00	1.50
7	000609	绵世股份	45,000	577,350.00	1.22
8	002332	仁和制药	50,000	560,000.00	1.18
9	002597	金禾实业	35,000	471,450.00	0.99
10	300408	三环集团	25,000	449,000.00	0.95

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	3,797,361.70	8.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	21,525,276.18	45.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,956,000.00	21.01
7	可转债	42,443,736.00	89.56
8	其他	-	-
9	合计	77,722,373.88	163.99

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	126018	08工债债	112,110	11,163,913.80	23.56
2	1282487	12华耀MTN1	100,000	9,956,000.00	21.01
3	128009	歌尔转债	69,000	8,886,510.00	18.75
4	113009	广汽转债	45,000	5,338,350.00	11.26
5	113008	电气转债	48,320	5,223,875.20	11.02

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
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在报告编制日前一年内除松芝股份(002454)、阳谷华泰(300121)外,没有受到公开谴责、处罚。
2015年11月27日,上海加冷松芝汽车空调股份有限公司(以下简称"松芝股份")控股股东陈福成先生因超比例减持未及时披露及在限制转让期限内减持"松芝股份"的行为被中国证券监督管理委员会以《行政处罚决定书》([2015]78号)给以警告处分以及合计处以240万元罚款。
2015年10月30日,山东阳谷华泰化工股份有限公司(以下简称"阳谷华泰")董事长、实际控制人、控股股东王传华因超比例减持未及时披露及在限制转让期限内减持"阳谷华泰"的行为被中国证券监督管理委员会以《行政处罚决定书》(〔2015〕48号)给以警告处分以及合计处以300万元罚款。
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,将该股票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	41,621.44
2	应收证券清算款	187,743.48
3	应收股利	-
4	应收利息	847,956.02
5	应收申购款	69,583.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,146,904.15

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	128009	歌尔转债	8,886,510.00	18.75
2	113008	电气转债	5,223,875.20	11.02
3	110030	格力转债	3,135,213.00	6.62
4	110031	航信转债	1,654,350.00	3.49
5	123001	蓝标转债	265,372.80	0.56

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
报告期期初基金份额总额	13,006,634.64	31,194,167.26
报告期期间基金总申购份额	14,976,174.98	6,014,257.44
减:报告期期间基金总赎回份额	14,777,688.73	11,106,553.04
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	13,205,120.89	26,101,871.66

§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

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信锋工具(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时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浙江同花顺基金销售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,富安达增强收益债券型证券投资基金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》;
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

东海祥瑞债券型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:东海基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月15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