富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017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:2017年10月27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2017年10月25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2017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	94,579,345.51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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	14,455,469.97
2.本期利润	16,651,556.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.1732
4.期末基金资产净值	223,631,274.48
5.期末基金份额净值	2.3645

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	7.88%	0.45%	2.63%	0.33%	5.25%	0.12%

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)

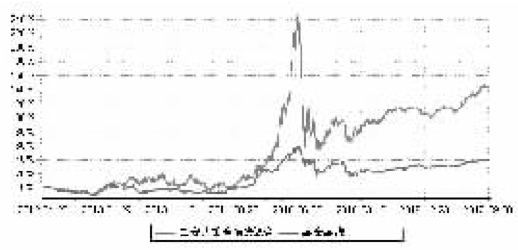
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年4月25日-2017年9月30日)



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	2015年5月12日	-	13年	硕士。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。2012年4月加入富安达基金管理有限公司任高级行业研究员兼基金经理助理。2015年5月起任富安达策略精选灵活配置混合型基金、富安达健康人生灵活配置混合型基金的基金经理(2015年11月25日至2016年12月17日期间)、富安达新动力灵活配置混合型基金的基金经理、富安达消费主题灵活配置混合型基金的基金经理。

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

2017年三季度市场整体呈现上涨的走势,上证指数涨幅接近5%、创业板指数涨幅近3%;策略精选在三季度净值上涨7.88%,跑赢了基准和指数;三季度市场分化仍然较大,其中周期类行业的表现较好,策略精选在季度初增加了部分周期类行业的配置,取得了一定的收益,但由于对环保政策的预期不足,导致对周期类行业的配置减持偏早;固定收益类配置方面,我们预计利率拐点仍未到来,并没有进行较多配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2017年9月30日,本基金份额净值为2.3645元,本报告期份额净值增长率为7.88%,同期业绩比较基准增长率为2.63%。

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	167,050,760.22	73.37
	其中:股票	167,050,760.22	73.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,423,452.80	8.53
	其中:债券	19,423,452.80	8.53
	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	21,400,000.00	9.40
	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	18,297,895.30	8.04
8	其他资产	1,519,578.74	0.67
9	合计	227,691,687.06	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

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	8,604,662.99	3.85
B	采矿业	14,338,667.81	6.41
C	制造业	72,504,793.91	32.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,015,330.78	0.45
E	建筑业	4,939,982.00	2.21
F	批发和零售业	6,609,762.65	2.96
G	交通运输、仓储和邮政业	7,119,243.61	3.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	43,128,834.02	19.29
K	房地产业	4,862,475.80	2.17
L	租赁和商务服务业	3,643,758.15	1.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	283,248.50	0.13
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	167,050,760.22	74.70

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	601288	农业银行	4,270,600	16,313,692.00	7.29
2	601988	中国银行	2,063,400	8,501,208.00	3.80
3	000651	格力电器	189,694	7,189,402.60	3.21
4	601398	工商银行	1,020,700	6,124,200.00	2.74
5	002714	牧原股份	165,125	6,121,183.75	2.74
6	601601	中国太保	159,932	5,906,288.76	2.64
7	000063	中兴通讯	178,188	5,042,720.40	2.25
8	600104	上汽集团	157,014	4,740,252.66	2.12
9	600584	长电科技	257,176	4,449,144.80	1.99
10	600438	通威股份	454,585	4,286,736.55	1.92

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	9,980,000.00	4.46
	其中:政策性金融债	9,980,000.00	4.46
4	企业债券	9,443,452.80	4.22
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	19,423,452.80	8.69

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	170301	17进出01	100,000	9,980,000.00	4.46
2	112155	12正邦债	94,890	9,443,452.80	4.22

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

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,在报告编制日前一年内除中兴通讯(000063)外,没有受到公开谴责、处罚。

中兴通讯于2017年3月8日公告其已就美国商务部工业与安全局(以下简称"BIS")、美国司法部及美国财政部海外资产管理办公室对其遵循美国出口管制条例及美国制裁法律情况的调查达成协议。鉴于中兴通讯违反了美国出口管制法律,并在调查过程中因提供信息及其他行为违反了相关美国法律法规,其已同意认罪并支付合计892,360,064美元罚款。此外,BIS还对中兴通讯处以暂缓执行的3亿美元罚款,在其于七年暂缓期内履行与BIS达成的协议要求的事项后将被豁免支付。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	79,526.48
2	应收证券清算款	653,830.33
3	应收股利	-
4	应收利息	453,389.04
5	应收申购款	332,832.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,519,578.74

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600584	长电科技	4,449,144.80	1.99	筹划非公开发行股票事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	97,319,989.74
报告期期间基金总申购份额	4,380,094.34
减:报告期期间基金总赎回份额	7,120,738.57
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	94,579,345.51

§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	16,479,158.15
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	16,479,158.15
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	17.42

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.2017年7月1日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司手机银行费率优惠活动的公告

2.2017年7月19日,富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2017年第2季度报告

3.2017年7月28日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与华泰证券认购、申购及定期定额投资手续费率优惠的公告

4.2017年8月24日,富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告正文及摘要

§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
二〇一七年十月二十七日

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017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:2017年10月27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2017年10月25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2017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	322,728,905.68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(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,006,969.28
2.本期利润	15,422,214.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0999
4.期末基金资产净值	462,339,006.60
5.期末基金份额净值	1.4326

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	24.16%	1.91%	4.19%	0.51%	19.97%	1.40%

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)

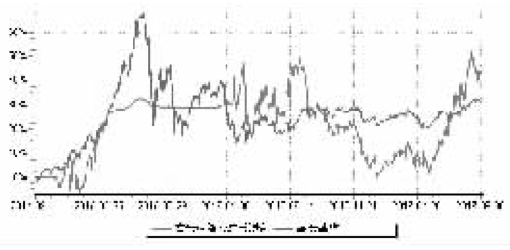
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年9月11日-2017年9月30日)



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	-	10年	硕士。历任齐鲁证券研究所行业研究员。2011年1月加入富安达基金管理有限公司任高级行业研究员兼基金经理助理。

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》。

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

报告期内宏观经济虽有起伏,但总体平稳,表现出极强的韧性。报告期内,美元走弱,人民币走强,流动性中性,供给侧改革深入推进,环保监管趋严,市场风险偏好有所提升,市场震荡上行,周期、大金融、创业板等轮动。

在投资策略方面,我们加强了行业趋势研究和公司调研,提高了对行业龙头、长期看好标的配置,选择坚守新能源汽车产业链和消费电子,随着行情的演绎,我们降低了估值优势不强、短期催化不足等标的的仓位,此外,根据市场风格轮动,我们也阶段性地参与了周期股、金融板块的投资机会。

追求业绩增长的确定性、估值合理是今年的投资主线,精选行业和个股仍是本基金的重要工作,景气度向上、符合国家产业政策的行业是重点配置领域。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2017年9月30日,本基金份额净值为1.4326元,本报告期份额净值增长率为24.16%,同期业绩比较基准增长率为4.19%。

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	426,362,886.84	90.52
	其中:股票	426,362,886.84	90.52
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	38,599,810.45	8.20
8	其他资产	6,051,454.31	1.28
9	合计	471,014,151.60	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

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	547,500.00	0.12
C	制造业	359,707,560.84	77.80
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	11,412,936.00	2.47
J	金融业	44,719,890.00	9.67
K	房地产业	9,975,000.00	2.16
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	426,362,886.84	92.22

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	603799	华友钴业	484,000	44,271,480.00	9.58
2	002460	赣锋锂业	494,712	43,188,357.60	9.34
3	002635	安洁科技	976,650	39,710,589.00	8.59
4	300450	先导智能	460,400	34,345,840.00	7.43
5	002241	歌尔股份	1,626,642	32,923,234.08	7.12
6	002466	天齐锂业	467,000	32,825,430.00	7.10
7	002384	东山精密	1,111,056	31,909,528.32	6.90
8	002456	欧菲光	1,367,600	28,979,444.00	6.27
9	601600	中国铝业	3,570,000	27,024,900.00	5.85
10	600999	招商证券	1,050,000	22,459,500.00	4.86

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

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,在报告编制日前一年内除赣锋锂业(002460)外,没有受到公开谴责、处罚。

赣锋锂业2016年11月4日发布《关于全资子公司美拜电子意外起火爆炸事件的进展公告》,其全资子公司美拜电子收到龙华新区安全生产监察部门《行政处罚决定书》(深宝龙安监管罚〔2016〕龙07101号、深宝龙安监管罚〔2016〕龙01702号),深圳市宝安区安全生产监督管理局龙华新区安全生产监察部门决定对美拜电子处以22万元罚款,对其法定代表人李万春处以9万元罚款。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	123,546.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,486.55
5	应收申购款	5,911,421.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,051,454.31

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601600	中国铝业	27,024,900.00	5.85	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	51,225,642.16
报告期期间基金总申购份额	466,034,278.32
减:报告期期间基金总赎回份额	194,531,014.80
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	322,728,905.68

§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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.2017年7月1日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司手机银行费率优惠活动的公告

2.2017年7月19日,富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2017年第2季度报告

3.2017年8月24日,富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告正文及摘要

§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新兴成长灵活配置混合型证券投资基金设立的文件:

《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

《富安达新兴成长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
二〇一七年十月二十七日

富安达现金通货币市场证券投资基金

2017 第三季度 报告

2017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:2017年10月27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2017年10月25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2017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	276,333,272.88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	本基金是货币市场基金,属于具有低风险收益特征的基金品种,其长期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金、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	103,269,550.54份	173,063,722.34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(2017年07月01日-2017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	750,550.61	3,889,165.88
2.本期利润	750,550.61	3,889,165.88
3.期末基金资产净值	103,269,550.54	173,063,722.34

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	0.9045%	0.0039%	0.0883%	0.0000%	0.8162%	0.0039%

2、富安达现金通货币B

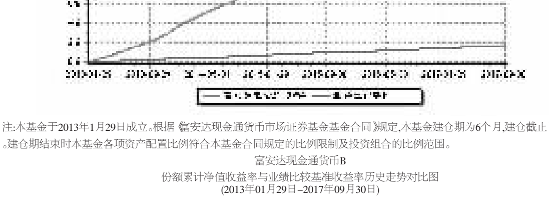
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9654%	0.0039%	0.0883%	0.0000%	0.8771%	0.0039%

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-2017年09月30日)

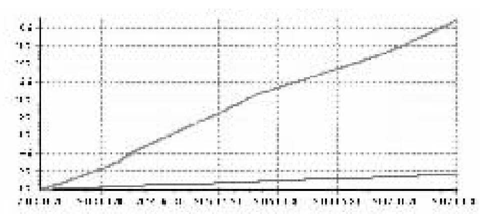


注:本基金于2013年1月29日成立。根据《富安达现金通货币市场证券基金基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2013年7月28日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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-2017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。

§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	2013年01月29日	-	9年	硕士。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。2011年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年起任富安达现金通货币市场证券投资基金、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10月25日至2016年10月25日期间)、富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理。

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》。

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

报告期内临近季末流动性较为紧张,十一后受定向降准等因素影响,资金面十分宽松,但债券迎来调整。9月CPI 1.6%,PPI 6.9%,整体略超预期。供需矛盾主导,涨价并不对称;上游涨价较多,中下游涨价幅度有限。近期央行行长周小川表示,中国将继续实行积极的财政政策和稳健的货币政策,并不断综合施策,补短板、去杠杆、警惕并防控影子银行、房地产市场泡沫等风险。十九大报告"透露"一些经济新信号:经济从追求增速向追求质量和效益的方向转变,金融的重点在于服务实体,不发生系统性风险是底线。显示目前宏观环境处于中性状态。9月1日,证监会正式发布《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》,自2017年10月1日起执行,给予半年的过渡期。预计货币基金的增长规模将受到约束,对组合久期要求更高,流动性会得到进一步提升。报告期内我们在做好流动性管理的前提下,根据市场波动、规模变动情况以及新规要求对组合债券和其他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0.9045%,富安达现金通货币B份额净值收益率为0.9654%,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

§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	固定收益投资	109,997,860.30	39.72
	其中:债券	69,989,497.49	25.27
	资产支持证券	40,008,362.81	14.45
2	买入返售金融资产	102,000,593.00	36.83
	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	60,756,221.93	21.94
4	其他资产	4,193,574.14	1.51
5	合计	276,948,249.37	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

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	1.78
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

注:本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120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。

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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120天的情况。

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	62.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	7.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.70	-

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 报告期内投资组合平均剩余期限超过240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240天的情况。

5.5 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(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	20,011,400.17	7.24
	其中:政策性金融债	20,011,400.17	7.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	39,993,673.76	14.47
6	中期票据	-	-
7	同业存单	9,984,423.56	3.61
8	其他	-	-
9	合计	69,989,497.49	25.33
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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。

5.6 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

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	120247	12国开47	200,000	20,011,400.17	7.24
3	011752009	17深能源SCP001	200,000	20,001,716.06	7.24
4	011759022	17物产中大SCP004	200,000	19,991,957.70	7.23
7	111790336	17营口银行CD010	100,000	9,984,423.56	3.61

5.7 "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	0.0693%
报告期内偏离度的最低值	0.0194%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0394%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142274	花呗10A1	200,000	20,003,620.30	7.24
2	142235	借呗04A1	100,000	10,002,396.09	3.62
3	142238	花呗09A1	100,000	10,002,346.42	3.62

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,430,623.61
4	应收申购款	762,950.53
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,193,574.14

§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	79,033,864.11	545,175,161.90
报告期期间基金总申购份额	127,802,769.96	142,029,949.77
报告期期间基金总赎回份额	103,567,083.53	514,141,389.33
报告期期末基金份额总额	103,269,550.54	173,063,722.34

§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	红利再投资	2017年07月03日	55,437.32	-	-
2	红利再投资	2017年08月01日	42,280.44	-	-
3	红利再投资	2017年09月01日	39,952.38	-	-
4	赎回	2017年08月18日	-2,000,000.00	-2,000,000.00	-
合计			-1,862,329.86	-2,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701-20170807	187000000	1052835.78	188050000	2835.78	-
机构	2	20170828-20170930	64412549.45	41280977.32	0	105693526.77	38.25%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时,基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产,由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本,造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1.2017年7月1日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司手机银行费率优惠活动的公告

2.2017年7月19日,富安达现金通货币市场证券投资基金2017年第2季度报告

3.2017年7月28日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与华泰证券认购、申购及定期定额投资手续费率优惠的公告

4.2017年8月24日,富安达现金通货币市场证券投资基金2017年半年度报告正文及摘要

5.2017年9月11日,富安达现金通货币市场证券投资基金更新招募说明书(二〇一七年第二号)正文及摘要

6.2017年9月25日,关于富安达现金通货币市场证券投资基金2017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

1.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》。

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
二〇一七年十月二十七日