富安达优势成长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	771,753,047.48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估值的分析,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,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的基金产品,其预期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	170,979,659.96
2.本期利润	124,526,497.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.1569
4.期末基金资产净值	1,615,121,093.97
5.期末基金份额净值	2.0928

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	8.21%	1.10%	3.52%	0.45%	4.69%	0.65%

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:

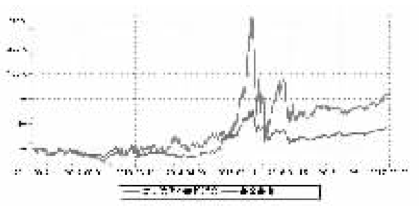
Return t =75%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t−1)−1]+25%×[上证国债指数t / 上证国债指数(t−1) −1]

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

富安达优势成长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
(2011年9月21日－2017年9月30日)



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		
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	–	22年	硕士。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。2015年10月加入富安达基金管理有限公司任研究发展部总监,富安达消费主题灵活配置混合型基金的基金经理。

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》。

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

报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场呈现稳步向上的形态,其中金融、电子、新能源、投资品等行业表现良好。本基金在三季度重点布局了集成电路、新能源光伏、生物医药、5G通信等行业,阶段性持有了投资品行业。

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2.0928元,本报告期份额净值增长率为8.21%,同期业绩比较基准增长率为3.52%。

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	1,499,951,102.93	88.22
	其中:股票	1,499,951,102.93	88.22
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	50,343,250.00	2.96
	其中:债券	50,343,250.00	2.96
	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	78,861,285.56	4.64
8	其他资产	71,029,587.05	4.18
9	合计	1,700,185,225.54	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

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	–	–
C	制造业	1,400,716,740.19	86.73
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	18,250,000.00	1.13
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	71,271,785.86	4.41
J	金融业	–	–
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	1,035,900.00	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	7,527,680.68	0.47
R	文化、体育和娱乐业	1,148,996.20	0.07
S	综合	–	–
	合计	1,499,951,102.93	92.87

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	601012	隆基股份	3,721,388	109,669,304.36	6.79
2	600438	通威股份	11,179,367	105,421,430.81	6.53
3	002185	华天科技	11,238,924	94,294,572.36	5.84
4	002273	水晶光电	3,671,598	93,772,612.92	5.81
5	600703	三安光电	3,920,583	90,722,290.62	5.62
6	300274	阳光电源	5,371,980	90,410,423.40	5.60
7	603005	晶方科技	2,491,182	82,308,653.28	5.10
8	000725	京东方A	17,867,477	78,616,898.80	4.87
9	603306	华懋科技	2,183,013	66,341,765.07	4.11
10	000063	中兴通讯	2,299,935	65,088,160.50	4.03

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	50,050,000.00	3.10
	其中:政策性金融债	50,050,000.00	3.10
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	293,250.00	0.02
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	50,343,250.00	3.12

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	150201	15国开01	500,000	50,050,000.00	3.10
2	132010	17桐昆EB	2,550	293,250.00	0.02

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

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,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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	815,491.62
2	应收证券清算款	68,656,073.29
3	应收股利	–
4	应收利息	1,211,509.24
5	应收申购款	346,512.90
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	71,029,587.05

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

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

报告期期初基金份额总额	816,714,921.28
报告期期间基金总申购份额	11,936,723.54
减:报告期期间基金总赎回份额	56,898,597.34
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	771,753,047.48

§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	27,183,886.56
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	27,183,886.56
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.52

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,富安达优势成长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,富安达优势成长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》。
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

富安达长盈保本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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。基金托管人上海浦东发展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	富安达长盈保本混合
基金主代码	002584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月11日
报告期末基金份额总额	180,544,453.29份
投资目标	通过运用投资组合保险技术,有效控制本金损失的风险,在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金运用 CPPI 恒定比例组合保险策略,动态调整安全资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保保本周期到期时,基金资产在保本基础上实现保值增值的目的。
业绩比较基准	二年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

§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

基金简称	报告期(2017年7月1日－2017年9月30日)
1.本期已实现收益	1,634,869.75
2.本期利润	1,462,360.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075
4.期末基金资产净值	182,077,791.30
5.期末基金份额净值	1.008

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本基金于2016年5月11日成立。

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	0.70%	0.03%	0.53%	0.00%	0.17%	0.03%

注:注:①本基金业绩比较基准为:二年期银行定期存款收益率

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:

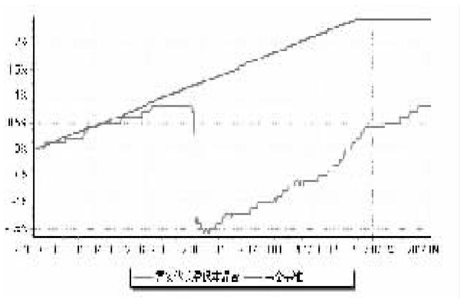
Return t =今日指数t / 昨日指数(t−1) −1

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

富安达长盈保本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
(2016年5月11日－2017年9月30日)



注:本基金于2016年5月11日成立,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2016年11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		
李飞	本基金的基金经理、投资管理部总监助理(主持工作)、公司固定收益部副总监(主持工作)	2016年5月11日	–	13年	硕士。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。2012年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年7月起任富安达增强收益债券型证券投资基金、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)。
张凯瑜	本基金的基金经理	2016年7月22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)。

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、《富安达长盈保本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。报告期内保本基金净值稳步增长,我们根据市场情况对组合的债券资产进行了相应的配置和调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年09月30日,本报告期富安达长盈保本混合份额净值为1.008元,净值增长率为0.70%,同期业绩比较基准增长率为0.53%。

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	–	–
	其中:股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	132,787,746.30	72.73
	其中:债券	112,805,746.30	61.79
	资产支持证券	19,982,000.00	10.94
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	16,468,264.70	9.02
	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	30,300,454.03	16.60
8	其他资产	3,012,810.22	1.65
9	合计	182,569,275.25	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

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票资产。

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资产。

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	1,805,655.60	0.99
2	央行票据	–	–
3	金融债券	9,989,000.00	5.49
	其中:政策性金融债	9,989,000.00	5.49
4	企业债券	41,112,090.70	22.58
5	企业短期融资券	50,220,000.00	27.58
6	中期票据	4,792,000.00	2.63
7	可转债	–	–
8	同业存单	4,887,000.00	2.68
9	其他	–	–
10	合计	112,805,746.30	61.95

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	112138	12苏宁01	141,000	14,104,230.00	7.75
2	122383	15恒大01	111,860	11,180,407.00	6.14
3	011756015	17桂铁投SCP001	100,000	10,051,000.00	5.52
4	011752009	17深能源SCP001	100,000	10,046,000.00	5.52
5	011759022	17物产中大SCP004	100,000	10,046,000.00	5.52

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	142235	借呗04A1	100,000	9,991,000.00	5.49
2	142238	花呗09A1	100,000	9,991,000.00	5.49

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

5.10.1 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,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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,739.88
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,011,070.34
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,012,810.22

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

本基金本报告期末未持有股票资产。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	207,154,303.33
报告期期间基金总申购份额	15,779.60
减:报告期期间基金总赎回份额	26,625,629.64
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	180,544,453.29

§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,富安达长盈保本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, 富安达长盈保本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长盈保本混合型证券投资基金设立的文件:
《富安达长盈保本混合型证券投资基金招募说明书》;
《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》;
《富安达长盈保本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

富安达增强收益债券型证券投资基金

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	45,475,416.55份	
投资目标	本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,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。 在进行固定收益类资产配置时,本基金首先通过久期配置、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。本基金的股票类资产作为整体基金投资组合管理的辅助工具,为投资人提供适度参与股票市场、获取超额收益的机会。	
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	20,588,847.94份	24,886,568.61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	608,544.11	690,683.32
2.本期利润	1,286,542.41	1,430,873.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0624	0.0590
4.期末基金资产净值	25,273,866.96	29,888,970.69
5.期末基金份额净值	1.2276	1.2010

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	5.45%	0.64%	0.76%	0.07%	4.69%	0.57%

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	5.33%	0.64%	0.76%	0.07%	4.57%	0.57%

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建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

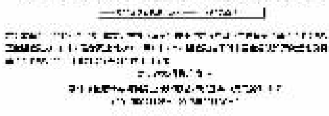
Return t =10%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t−1)−1]+90%×[中债总财富总指数t / 中债总财富总指数(t−1) −1]

Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t−1)

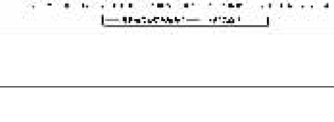
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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

富安达增强收益债券A
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07月25日－2017年09月30日)



[illegible]



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07月04日		13年	博士。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。2012年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年7月起任富安达增强收益债券型证券投资基金、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 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

报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度金融监管节奏明显趋缓,央行则加强了市场预期管理。国内经济增长强劲,利率高位回稳,人民币升值远超预期,市场风险偏好显著回升。市值风格逐渐收敛,大盘价值依旧稳定,市场逐渐向周期成长性主题演进。债券市场较为平淡,宏观金融去杠杆,监管严控各类合规风险,通胀预期较为强烈,除6−7月份出现短暂行情外,现货市场大多处于弱势调整状态,估值收益缓步走高。本基金在报告期内降低久期和杠杆,对权益类资产做了重点投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,富安达增强收益债券A份额净值为1.2276元,C份额净值为1.2010元;本报告期富安达增强收益债券A份额净值增长率为5.45%,C份额净值增长率为5.33%,同期业绩比较基准增长率为0.76%。

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	11,218,129.21	14.88
	其中:股票	11,218,129.21	14.88
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	60,640,306.40	80.43
	其中:债券	60,640,306.40	80.43
	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	2,136,068.73	2.83
8	其他资产	1,402,613.13	1.86
9	合计	75,397,117.47	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	–	–
C	制造业	8,991,310.37	16.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	648,600.00	1.18
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	1,578,218.84	2.86
J	金融业	–	–
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	11,218,129.21	20.34

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	002497	雅化集团	79,868	1,475,161.96	2.67
2	300323	华灿光电	74,000	1,363,820.00	2.47
3	002273	水晶光电	40,000	1,021,600.00	1.85
4	300088	长信科技	110,000	976,800.00	1.77
5	603019	中科曙光	24,569	906,350.41	1.64
6	300100	双林股份	30,000	778,800.00	1.41
7	600667	太极实业	98,000	749,700.00	1.36
8	600198	大唐电信	45,900	735,318.00	1.33
9	600326	西藏天路	60,000	648,600.00	1.18
10	300383	光环新网	43,000	599,420.00	1.09

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	2,929,534.50	5.31
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	5,516,366.68	10.00
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据		–
7	可转债	52,194,405.22	94.62
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	60,640,306.40	109.93

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	110034	九州转债	43,970	5,425,018.60	9.83
2	128010	顺昌转债	43,813	5,161,609.53	9.36
3	127004	模塑转债	45,233	4,942,609.91	8.96
4	113011	光大转债	42,270	4,709,723.40	8.54
5	113009	广汽转债	36,440	4,617,312.40	8.37

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,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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	37,015.36
2	应收证券清算款	1,006,828.30
3	应收股利	–
4	应收利息	293,770.85
5	应收申购款	64,998.62
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,402,613.13

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110034	九州转债	5,425,018.60	9.83
2	128010	顺昌转债	5,161,609.53	9.36
3	113011	光大转债	4,709,723.40	8.54
4	113009	广汽转债	4,617,312.40	8.37
5	110033	国贸转债	4,463,039.30	8.09
6	132001	14宝钢EB	3,830,564.40	6.94
7	110032	三一转债	3,659,860.00	6.63
8	132006	16皖新EB	3,040,800.00	5.51
9	132005	15国资EB	2,392,335.00	4.34
10	120001	16以岭EB	899,365.40	1.63
11	110030	格力转债	113,566.80	0.21

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	300100	双林股份	778,800.00	1.41	重大资产重组

§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	20,581,813.55	24,096,643.44
报告期期间基金总申购份额	4,096,264.85	5,080,353.72
减:报告期期间基金总赎回份额	4,089,230.46	4,290,428.55
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	20,588,847.94	24,886,568.61

§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

	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额		4,873,456.05
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		4,873,456.05
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	–	10.72

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

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	20170701－20170930	10114996.33	0	0	10114996.33	22.24%
个人	1	20170701－20170930	10029526.94	0	0	10029526.94	22.05%
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,富安达增强收益债券型证券投资基金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,富安达增强收益债券型证券投资基金2017年半年度报告正文及摘要
5.2017年9月7日,富安达增强收益债券型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

§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
二〇一七年十月二十七日