



信息披露

2013年8月29日 星期四
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B100

富安达现金货币市场证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

2013年上半年度,托管人在富安达现金货币市场证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明
2013年上半年度,富安达现金货币市场证券投资基金运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本基金报告期内向A级份额持有人分配利润:2,128,614.82元,向B级份额持有人分配利润:1,708,694.54元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见
2013年上半年度,由富安达基金管理有限公司并经托管人复核审查的有关富安达现金货币市场证券投资基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体:富安达现金货币市场证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日
资产:		
银行存款	6.4.6.1	3,357,680.72
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.6.2	70,113,687.70
其中:股权投资		-
基金投资		70,113,687.70
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.6.3	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	42,750,384.13
应收票据/应收款		-
应收利息	6.4.6.5	1,106,560.99
应收股利		-
应收申购款		355,100.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.6.6	-
资产总计		117,683,413.54
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
应付票据/应付款	6.4.6.3	816,563.73
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		37,963.04
应付托管费		11,503.97
应付销售服务费		13,017.98
应付交易费用	6.4.6.7	14,036.35
应交税费		-
其他负债		-
负债合计		977,797.05
所有者权益:		
实收基金	6.4.6.9.2	117,404,179.42
未分配利润	6.4.6.10	117,404,179.42
所有者权益合计		117,683,413.54
负债和所有者权益总计		117,683,413.54

注1:报告截止日2013年6月30日,富安达现金货币市场证券投资基金A类和B类基金份额净值均为1.0000元,基金总份额117,404,179.42份,其中A类基金份额43,678,990.56份,B类基金份额73,725,188.86份。

2.本基金合同于2013年1月29日生效,本财务报表的实际编制期间为2013年1月29日至2013年6月30日。

6.2 利润表

会计主体:富安达现金货币市场证券投资基金

报告期间:2013年1月29日-2013年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月29日-2013年6月30日
一、收入		4,815,106.41
1.利息收入		4,432,569.82
其中:存款利息收入	6.4.6.11	1,837,286.00
债券利息收入		816,563.73
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,778,720.09
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”号填列)		382,536.59
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.12	382,536.59
资产支持证券投资收益		-
公允价值变动收益	6.4.6.13	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-
减:二、费用		977,797.05
1.管理人报酬		425,274.42
2.托管费		129,097.50
3.销售服务费		192,143.11
4.交易费用		-
5.利息支出		27,558.63
其中:卖出回购金融资产支出		27,558.63
6.其他费用	6.4.6.14	203,723.39
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,837,309.36
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3,837,309.36

注:本基金合同于2013年1月29日生效,上表中“本期”指2013年1月29日至2013年6月30日期间,不满六个月。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:富安达现金货币市场证券投资基金

报告期间:2013年1月29日-2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月29日-2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	994,024,416.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-3,837,309.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-876,620,236.70
其中:1.基金申购款	333,252,016.49
2.基金赎回款	-1,209,872,253.19
四、期末所有者权益(基金净值)	117,404,179.42

注:本基金合同于2013年1月29日生效,上表中“本期”指2013年1月29日至2013年6月30日期间,不满六个月。

报表附注为财务报表的重要组成部分。
本报告至财务报表由下列负责人签署:

曹晓刚	曹晓刚	王晋才	王晋才
基金管理人负责人	基金管理人负责人	基金管理人负责人	基金管理人负责人

6.4 报表附注

6.4.1 会计报表的编制基础

本财务报表按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则制定,其后颁布的应用指南、解释、以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务和份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.2 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年半年度的经营成果和基金净值变动等有关信息。

6.4.3 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的声明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则制定及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.3.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.3.2 记账本位币

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币,除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.3.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)资产分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应

收款项等,应收款项是指在活跃市场中没有报价,回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2. 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量,应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本报告期内,基金管理人全资子公司-富安达资产管理(上海)有限公司正式注册成立。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司(“南京证券”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构
富安达资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.6.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.6.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2013年1月29日-2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	425,274.42
其中:应付销售机构的客户维护费	237,226.51

注1:1、支付基金管理人A的基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人及销售机构约定由管理人向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

3.本基金于2013年1月29日成立,本期数据按实际存续期计算。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2013年1月29日-2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	129,097.50

注1:1、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

2.本基金于2013年1月29日成立,本期数据按实际存续期计算。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月29日-2013年6月30日
当期发生的基金应支付的销售服务费	192,143.11
其中:应付销售机构的客户维护费	192,143.11
富安达基金管理有限公司	1,517.46
交通银行股份有限公司	182,563.29
南京证券股份有限公司	1,329.43
合计	185,401.18

注1:1、支付基金销售机构的现金A、B类销售服务费分别按前一日现金A类基金资产净值0.25%、B类基金资产净值0.01%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给富安达基金,再由富安达基金计算并支付给各基金销售机构,其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值×年销售服务费/当年天数

2.本基金合同于2013年1月29日生效,本期数据按实际存续期计算。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易。

6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期2013年1月29日-2013年6月30日		上年度可比期间	
	富安达现金货币市A	富安达现金货币市B	富安达现金货币市A	富安达现金货币市B
期初持有的基金份额	--	--	--	--
期间申购/买入总份额	--	16,097,442.45	--	--
期间赎回/卖出总份额	--	--	--	--
减：期间赎回/卖出总份额	--	--	--	--
期末持有的基金份额	--	16,097,442.45	--	--
期末持有的基金份额占基金总份额比例	--	13.71%	--	--

6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称		上年度末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
		持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额 的比例
A类	南京证券股份有限公司	4000000	9.18%		-
B类	富安达资产管理(上海)有限公司	18003449.6	24.47%		0.00%

6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	期末 余额	当期 存款利息收入	期末 余额	当期 存款利息收入
交通银行(活期存款)	3,357,680.72	54,414.63	-	-
交通银行(定期存款)	-	1,776,619.94	-	-

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.6.6 其他关联交易事项的说明

本基金报告期内无其他关联交易事项。

6.4.7 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.7.1 期末流通受限证券情况说明

6.4.7.1.1 报告期末债券正回购
本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。
6.4.7.1.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

§7 投资组合报告

7.1 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	固定收益资产	70,113,687.70	59.58
其中:债券		70,113,687.70	59.58
资产支持证券		-	-
2	买入返售金融资产	42,750,384.13	36.33
其中:买入返售金融资产中的买入返售金融资产		-	-
3	银行存款和结算备付金合计	3,357,680.72	2.85
其他各项资产		1,461,660.99	1.24
合计		117,683,413.54	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。

7.2债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.17	-
其中:报告期内债券回购融资余额		-	-
其中:项目	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
其中:报告期内债券回购融资余额		-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

金额单位:人民币元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2013-04-09	28.79	因大额赎回导致基金资产净值下降,融资余额超过基金资产净值20%的比例	1
2	2013-05-21	29.77	因大额赎回导致基金资产净值下降,融资余额超过基金资产净值20%的比例	1

注:本基金本报告期内,除发生两次因大额赎回导致基金债券回购融资余额超过基金资产净值20%的情况,并按规定在5个交易日内及时调整外,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。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。根据本基金的基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超120天,下同。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	报告期期末投资组合平均剩余期限占基金资产净值的比例(%)	报告期期末投资组合平均剩余期限占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	56.29	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债		8.51	-
2	30天(含)-60天	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债		-	-
3	60天(含)-90天	8.54	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债		-	-
4	90天(含)-180天	17.12	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债		-	-
5	180天(含)-397天(含)	17.04	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债		-	-
合计		98.99	-

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。

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,983,643.55	17.02
其中:政策性金融债		19,983,643.55	17.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,130,044.15	42.70
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	70,113,687.70	59.72
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,992,231.01	8.51

7.5期末