中加货币市场基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:中加基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
报告送出日期:2014年01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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月17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2013年10月21日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中加货币
基金主代码	000331
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月21日
报告期末基金份额总额	3,605,332,361.89份
投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,追求超过业绩比较基准的现金收益。
投资策略	本基金投资策略将审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,力求将各类风险降到最低,在控制投资组合良好流动性的前提下为投资者获取稳定的收益。主要投资策略包括:①短期利率水平预期策略;②收益率曲线分析策略;③组合剩余期限策略、期限配置策略;④类别品种配置策略;⑤票息投资策略;⑥流动性管理策略。
业绩比较基准	七天通知存款利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,平均剩余期限控制在120天以内,属于低风险、高流动性、预期收益稳健的基金产品。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	中加货币A / 中加货币C
下属两级基金的交易代码	000331 / 000332
报告期末下属两级基金的份额总额	1,108,965,229.47 / 2,496,367,132.42

§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(2013年10月21日-2013年12月31日)	
	中加货币A	中加货币C
1.本期已实现收益	16,806,796.22	36,192,965.44
2.本期利润	16,806,796.22	36,192,965.44
3.期末基金资产净值	1,108,965,229.47	2,496,367,132.42

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、中加货币A

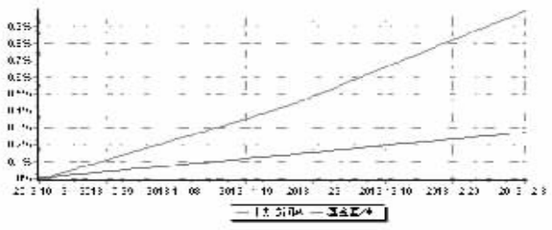
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日起至今(2013年10月21日-2013年12月31日)	0.9899%	0.0021%	0.2663%	0.0000%	0.7236%	0.0021%

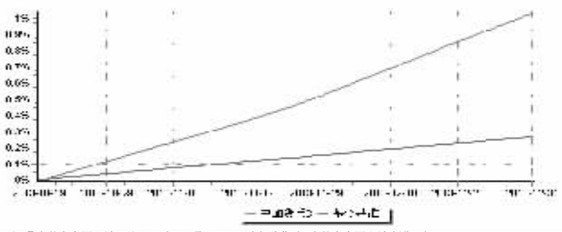
2、中加货币C

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
自基金合同生效日起至今(2013年10月21日-2013年12月31日)	1.0374%	0.0021%	0.2663%	0.0000%	0.7711%	0.0021%

注:本基金的收益分配是按月结转。

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





注:①本基金合同生效日为2013年10月21日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

②按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末,基金合同生效未满6个月,截至2013年12月31日,本基金各项指标已满足资产配置比例要求。

§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		
闫沛贤	基金经理	2013年10月21日	-	5	2008年至2013年分别任职于平安银行资金交易部和北京银行资金交易部,2013年加入中加基金管理有限公司,任基金经理。2013年10月至今担任中加货币A/C基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守《基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,本基金的基金管理人仅管理一只产品,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年4季度经济基本保持平稳趋强的态势,10月份CPI较9月份略上行0.1百分点,11月份转而向下,下半年通胀整体呈现抬头趋势但压力不大。

10月初,央行延续公开市场操作平滑国庆节前后资金面压力,后受3季度经济数据表现较好和通胀上抬的压力,加上外汇占款大幅回升,央行暂停逆回购操作;10月末11月初,央行重启逆回购,低量高价;11月中旬,逆回购整体规模继续缩减,央票到期续作,显示政策对流动性的态度仍然谨慎;12月份迎来财政存款投放高峰期,公开市场投放量顺势缩减,逆回购再次暂停;临近年末,再次爆发小型"钱荒",资金利率显著上行,后央行重启7天逆回购,对资金面形成一定支撑。主要受流动性和央行态度影响,1年期政策性金融债从季度初的4.51%逐步上行到12月份5.40%左右的水平,AAA级短融从5.06%逐步上行到6.30%,AA级短融从5.77%逐步上行到7.05%。其中11月份上行幅度较大,12月份小幅震荡上行。

本基金于11月20日首日打开,后结合对客户需求以及市场情况的判断,合理安排现金流,平衡组合流动性与收益。考虑到短期资金面居高不下,基金保持了相对较高的存款配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内中加货币A净值收益率为0.9899%,中加货币C净值收益率为1.0374%,业绩比较基准收益率0.2663%。

§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	固定收益投资	901,649,474.85	23.44
	其中:债券	901,649,474.85	23.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	350,000,770.00	9.10
	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	2,445,335,297.70	63.57
4	其他资产	149,414,855.93	3.88
5	合计	3,846,400,398.48	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	175,792,322.10 / 4.88
	其中:买断式回购融资	- / -

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	73
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	6

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

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均不得超过120天。本报告期内无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	58.56	4.88
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	11.98	-
2	30天(含)—60天	8.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	5.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	20.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	8.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.16	4.88

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	680,102,333.96	18.86
	其中:政策性金融债	680,102,333.96	18.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	221,547,140.89	6.14
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	901,649,474.85	25.01
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	431,858,655.28	11.98

5.5 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

金额单位:人民币元

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	130215	13国开15	2,400,000	235,708,134.30	6.54
2	130227	13国开27	2,000,000	198,305,261.34	5.50
3	110221	11国开21	2,000,000	196,150,520.98	5.44
4	DD5151	13苏交通CP007	500,000	49,943,466.93	1.39
5	130210	13国开10	500,000	49,938,417.34	1.39
6	DD5345	13玖龙太仓CP002	470,000	46,708,308.78	1.30
7	DD5309	13玖龙太仓CP001	400,000	40,019,286.46	1.11
8	GD2801	13方正证券CP001	350,000	34,995,587.81	0.97
9	DD5974	13阳交运CP003	300,000	29,894,072.21	0.83
10	DD6440	13登星CP003	200,000	19,986,418.70	0.55

5.6 "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	0.0137%
报告期内偏离度的最低值	-0.0461%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0236%

5.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

1.本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用"摊余成本法"估值前,本基金暂不投资于交易所短期债券。

2.为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。当"摊余成本法"计算的基金资产净值与"影子定价"确定的基金资产净值偏离达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,其中,对于偏离程度达到或超过0.5%的情形,基金管理人应与基金托管人协商一致后,参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值,并且按相关规定进行临时公告。

3.如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

4.相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.8.2 本报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计在每个交易日均未超过基金资产净值20%。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未收到公开谴责、处罚。

5.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	25,125,355.93
4	应收申购款	124,289,500.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	149,414,855.93

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	中加货币A	中加货币C
本报告期期初基金份额总额	2,302,992,307.69	4,569,835,095.23
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,042,642,226.12	2,021,984,418.08
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,236,669,304.34	4,095,452,380.89
本报告期期末基金份额总额	1,108,965,229.47	2,496,367,132.42

注:总申购份额中包含红利再投份额。

§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	申购	2013年12月19日	90,000,000.00	90,000,000.00	-
2	申购	2013年12月23日	100,000,000.00	100,000,000.00	-
3	申购	2013年12月26日	80,000,000.00	80,000,000.00	-
4	红利再投	2014年01月02日	416,864.10		-
合计			270,416,864.10	270,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准中加货币市场基金设立的文件;

2.《中加货币市场基金基金合同》;

3.《中加货币市场基金托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

5.报告期内中加货币市场基金在制定报刊上披露的各项公告的原稿。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址:北京市丰台区南四环西路188号17区15号12层

基金托管人地址:北京市西城区太平桥大街25号光大中心

投资者对本报告书如有疑问,可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话:400-00-95526(免长途费)

基金管理人网址:www.bobbns.com

中加基金管理有限公司

二〇一四年一月二十日

富安达现金通货币市场证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31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:2014年01月21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2014年1月20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2013年10月1日起至12月31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	324,217,147.52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	本基金属于货币市场基金,属于低风险产品。一般情况,其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
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
下属两级基金的基金简称	富安达现金通货币A / 富安达现金通货币B
下属两级基金的交易代码	710501 / 710502
报告期末下属两级基金的份额总额	25,609,192.16 / 298,607,955.36

§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(2013年10月01日-2013年12月31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	355,773.57	1,880,005.65
2.本期利润	355,773.57	1,880,005.65
3.期末基金资产净值	25,609,192.16	298,607,955.36

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。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。

②基金于2013年1月29日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

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

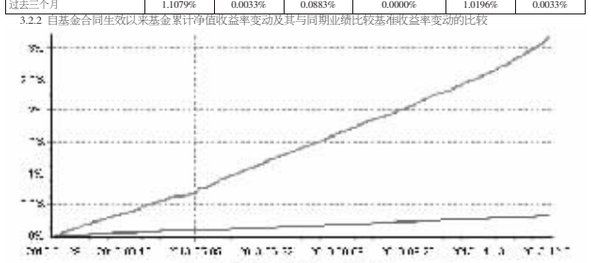
1.富安达现金通货币A

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	1.0467%	0.0033%	0.0883%	0.0000%	0.9584%	0.0033%

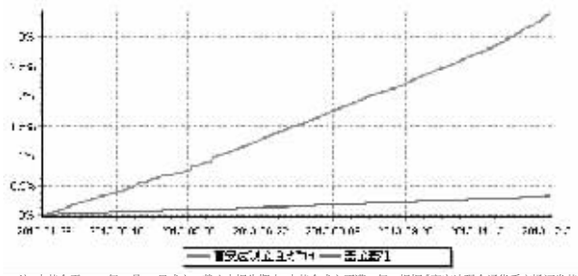
2.富安达现金通货币B

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	1.1079%	0.0033%	0.0883%	0.0000%	1.0196%	0.0033%

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



注:本基金于2013年1月29日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。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。



注:本基金于2013年1月29日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。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,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01月29日	-	5年	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,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 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》、《证券投资基金运作管理办法》及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》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起,监察稽核部定期对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日、5日和10日时间窗分析同向交易中存在价格差异的样本。通过对各投资组合间以及单个组合与组合类别间的公平交易结果分析,在特定时间窗内交易证券的溢价率和溢价金额均在正常范围内,因此不构成潜在利益输送的显著性。

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

报告期内由于临近年末因素,资金成本居高不下,年末时点各期限资金价格更是逼近年中钱荒时的高点,债券市场也依然处于调整态势。在持仓方面,我们对债券进行了部分调仓,降低了组合久期,保持了较低仓位,并且通过资金价格的波动调整回存和回购的期限和比例,在保持流动性的前提下锁定收益。

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1.0467%,富安达现金通货币B份额净值收益率为1.1079%,同期业绩比较基准收益率为0.0883%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年初资金面有所缓解,但债市仍有压力,一方面市场成员的配置意愿不高,市场观望气氛较浓;另一方面央行持续谨慎的态度加之IPO重启等因素,预计今年流动性环境不容乐观。目前众多债券的收益率较为可观,但基础不稳,债券价格上涨空间有限。我们将继续关注利率市场和债券市场,加强对组合内各类资产的管理,合理配置基金资产。

§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	固定收益投资	39,973,743.19	12.31
	其中:债券	39,973,743.19	12.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	19,600,149.40	6.04
	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	263,493,288.59	81.15
4	其他资产	1,615,315.83	0.50
5	合计	324,682,497.01	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

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.57
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值比例(%)
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	34
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	68
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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180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。

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	84.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.08	-
2	30天(含)—60天	3.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	12.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.65	-

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。

5.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,973,381.98	9.24
	其中:政策性金融债	29,973,381.98	9.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,000,361.21	3.08
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	39,973,743.19	12.33
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,994,713.33	3.08

5.5 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

金额单位:人民币元

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	041356017	13天山水泥CP002	100,000	10,000,361.21	3.08
2	120233	12国开33	100,000	9,994,713.33	3.08
3	130201	13国开01	100,000	9,993,030.89	3.08
4	130210	13国开10	100,000	9,985,637.76	3.08

5.6 "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	20
报告期内偏离度的最高值	-0.0721%
报告期内偏离度的最低值	-0.3442%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2062%

5.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 报告期内,本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的20%。

5.8.3 报告期内,本基金投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。

5.8.4 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,498,117.11
4	应收申购款	117,198.72
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	1,615,315.83

§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
本报告期期初基金份额总额	23,543,978.51	99,943,301.71
本报告期基金总申购份额	71,695,159.52	547,542,101.41
减:本报告期基金总赎回份额	69,629,945.87	348,877,447.76
本报告期期末基金份额总额	25,609,192.16	298,607,955.36

注:①报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入机分级份额调增份额;总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

②本基金于2013年1月29日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

§7 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

2013/10/09 关于增加深圳众禄基金销售有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构及开通开放式基金通过网上交易方式办理申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告

2013/10/22 富安达现金通货币市场证券投资基金2013年第3季度报告

2013/12/31 富安达基金管理有限公司2013年12月31日基金净值公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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》

《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》

基金管理人业务资格批件和营业执照

基金托管人业务资格批件和营业执照

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

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

二〇一四年一月二十一日

富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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2014年1月20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2013年10月25日(产品成立日)起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达信用纯债债券发起式
基金主代码	000284
交易代码	000284
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月25日
报告期末基金份额总额	99,544,133.64份
投资目标	本基金为纯债基金,在追求控制信用风险和保持基金资产流动性的基础上,力争获得超越比较基准的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	信用债券是本基金投资的核心主题,信用债券策略是本基金债券投资的核心策略。本基金将基于对整体收益率与信用利差的判断以及对发行人和发行条款的深入研究精选个券,确定具体信用债券的配置。 本基金主要从宏观经济周期的角度出发,基于对宏观经济周期、收益率曲线和信用利差的判断,分析并筛选出特定经济阶段下具有相对优势的期限与信用等级的债券进行配置。 本基金将利用目前的交易所和银行间两个投资市场的利差不同,密切关注两市场之间的利差波动情况,在两市场之间轮动切换,积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。
业绩比较基准	中债总指数收益率。
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	中国农业银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	富安达信用主题A / 富安达信用主题C
下属两级基金的交易代码	000284 / 000285
报告期末下属两级基金的份额总额	40,242,389.41 / 59,301,744.23

§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(2013年10月25日-2013年12月31日)	
	富安达信用主题A	富安达信用主题C
1.本期已实现收益	1,515,237.06	2,873,662.99
2.本期利润	1,519,106.31	2,881,220.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084	0.0074
4.期末基金资产净值	40,639,287.16	59,790,561.93
5.期末基金份额净值	1.0099