富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2012】半年度报告摘要

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
送出日期:2012年8月25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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。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2012年8月23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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	319,796,308.91份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	本基金主要采用自下而上的个股精选策略,通过GARP策略精选具有成长潜力和合理估值的上市公司,在此基础上结合研究团队的定性分析及实地调研,动态调整本基金的投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率x55%+上证国债指数收益率x 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋晓刚	张咏东
	联系电话	021-61870999	021-32169999
	电子邮箱	service@fadfunds.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999(免长途)021-61870666	95559
传真		021-61870888	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年4月25日至2012年6月30日)
本期已实现收益	-7,443,931.94
本期利润	-8,315,387.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0148
本期基金份额净值增长率	-1.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0197
期末基金资产净值	315,391,648.26
期末基金份额净值	0.9862

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,例如:基金的认购、申购、赎回费等,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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金于2012年4月25日成立。截至本报告期末,本基金成立不满六个月。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-1.40%	0.19%	-3.45%	0.60%	2.05%	-0.41%
自基金合同生效日起至今(2012年04月25日-2012年06月30日)	-1.38%	0.16%	-2.68%	0.60%	1.30%	-0.44%

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 (-1)-1]+45%× [上证国债指数t/上证国债指数 (-1)-1]

Benchmark t = (1+Return t)×Benchmark (-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份额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
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年4月25日-2012年6月30日)

注:1.本基金于2012年4月25日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2.根据《富安达策略精选混合型证券投资基金基金合同》规定,本基金应自2012年4月25日成立起六个月内,达到本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围,目前本基金还在建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司2011年4月13日经中国证监会批准设立,2011年4月27日正式成立。公司注册资本1.6亿元人民币,注册地上海。由南京证券有限责任公司(占比49%)、江苏交通控股有限公司(占比26%)、南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司(占比25%)三家股东单位共同发起设立。公司秉承"诚信、专业、稳健、规范、创新"的经营理念,始终将"基金持有人利益最大化"作为首要经营目标,为客户提供卓越的理财服务。

截至2012年6月30日,公司共管理两只开放式证券投资基金:包括富安达优势成长股票型证券投资基金和富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
黄强先生	本基金的基金经理、研究发展部副总监	2012年4月25日	-	18年	黄强先生,上海财经大学经济学硕士,18年证券投资研究从业经验。历任浙江财政证券公司投资二部投资经理,光大证券有限公司资产管理部投资经理、研究所策略分析师,泰信基金管理有限公司投资理财部高级投资经理,光大保德信基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、首席策略分析师。2010年4月加入富安达基金筹备组,2011年4月至今任富安达基金管理有限公司研究发展部副总监。

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》、《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过多种手段对公平交易进行监控,涵盖了股票、权证、债券等所有投资品种,以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资活动,同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。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》。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,A股市场尤其上证综指呈现通俗意义上的"M"头走势,如果布局得当,将有获取较好正收益的机会,但遗憾的是本基金成立基本上在二季度的市场高点区间。从基金成立开始,受欧债危机深化演绎,国内数据疲弱等因素影响,市场对中国经济长期增长动力缺乏信心以及对刺激政策预期有所落空,市场下跌明显,及时降息亦未能改变下跌趋势。虽然我们对货币政策调整的判断基本准确,但市场的表现的确弱于预期。本基金表现好于市场及业绩基准,超额收益主要来自资产配置的贡献,但总体未能获得绝对收益。由于市场整体下跌,虽然我们在地产、医药等行业上的个股选择获得较好收益,但其他行业和个股的配置未能形成贡献,因此在行业配置和个股选择上的努力未能获取显著收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2012年6月30日,本基金份额净值为0.9862元,份额累计净值为0.9862元。本报告期基金份额净值增长率为-1.38%,同期基金业绩比较基准的收益率为-2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为三季度CPI的下行会为宽松政策腾出空间,再次降息成为可能,实际上,7月初已经降息。此外,从近期央行在银行间市场的动作分析,三季度降准存在可能性。从经济增长角度来看,宏观经济二季度环比见底应该是大概率事件,稳增长的目标可以实现。但目前市场关注的焦点似乎有所转移,市场更加关注增长乏力和长期增长动力的问题。我们基本认同不会有太大力度的刺激政策,但年内经济下行空间应该比较有限;稳增长能够实现,但的确不可能很快重拾高增长,除非在科技创新或者政策红利上取得突破和明显进展,因此宏观经济维持一个合理水平的稳定增长是大概率事项。目前市场的确还处于弱市之中,在指数逼近年初低点之际,我们仍旧坚持谨慎操作,但的确不愿意太悲观。市场可能更多的受制于企业盈利低迷和融资供求压力,在这种背景下,确定性的增长显得尤为重要。从市场结构来看,估值的分化也体现了这种诉求,从宏观背景看,我们相对看好非银行金融、地产以及医药、消费等稳定增长性行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,公司总经理担任估值委员会主席,研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2012年上半年度,基金托管人在富安达策略精选灵活配置混合型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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年上半年度,富安达基金管理有限公司在富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2012年上半年度,由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、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:富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日
资产:		
银行存款		127,297,879.58
结算备付金		55,196,736.11
存出保证金		-
交易性金融资产		37,581,475.12
其中:股票投资		17,595,475.12
基金投资		-
债券投资		19,986,000.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		118,600,671.90
应收证券清算款		1,997,675.88
应收利息		120,981.83
应收股利		-
应收申购款		98.81
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		340,795,519.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		24,211,953.45
应付管理人报酬		674,411.39
应付托管费		112,401.86
应付销售服务费		-
应付交易费用		217,757.38
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		187,346.89
负债合计		25,403,870.97
所有者权益:		
实收基金		319,796,308.91
未分配利润		-4,404,660.65
所有者权益合计		315,391,648.26
负债和所有者权益总计		340,795,519.23

注:1、报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.9862元,基金份额总额319,796,308.91份。

2、本基金于2012年4月25日成立,本报表实际编制期间为2012年4月25日(基金合同生效日)至2012年6月30日,不满六个月。

6.2 利润表

会计主体:富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012年4月25日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2012年4月25日至2012年6月30日
一、收入		-6,057,365.63
1.利息收入		2,364,871.01
其中:存款利息收入		1,642,727.02
债券利息收入		12,624.66
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		709,519.33
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-7,875,354.60
其中:股票投资收益		-8,446,177.35
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		570,822.75
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-871,455.43
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列		324,573.39
减:二、费用		2,258,021.74
1.管理人报酬		1,534,148.17
2.托管费		255,691.32
3.销售服务费		-
4.交易费用		367,751.66
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		100,430.59
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-8,315,387.37
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-8,315,387.37

注:本基金合同于2012年4月25日生效,上表中"本期"指2012年4月25日至2012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:富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012年4月25日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年4月25日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	583,363,852.64	-	583,363,852.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,315,387.37	-8,315,387.37
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)	-263,567,543.73	3,910,726.72	-259,656,817.01
其中:1.基金申购款	191.21	-2.90	188.31
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-263,567,734.94	3,910,729.62	-259,657,005.32
四、本期间基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	319,796,308.91	-4,404,660.65	315,391,648.26

注:本基金合同于2012年4月25日生效,上表中"本期"指2012年4月25日至2012年6月30日期间,不满六个月。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至财务报表由下列负责人签署:

李剑锋　　蒋晓刚　　袁欣

基金管理公司负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《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。

6.4.1.1 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。

6.4.1.2 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。

6.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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)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。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。

6.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或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。

6.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.1.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润。

6.4.1.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.1.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.1.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.1.12 分部报告

无。

6.4.1.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

1、对于特殊事项停牌股票,根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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,与本基金管理人存在控制关系的股东南京证券有限责任公司,其持股5%以上的股东的持股比例发生变化。

6.4.3.2 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
南京证券有限责任公司("南京证券")	基金管理人的控股股东、基金销售机构

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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

1、本基金本报告期内(2012年4月25日至2012年6月30日)没有通过关联方交易单元进行股票交易。

2、本基金于2012年4月25日成立,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.1.2 权证交易

1、本基金本报告期内(2012年4月25日至2012年6月30日)没有通过关联方交易单元进行权证交易。

2、本基金于2012年4月25日成立,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.1.3 债券交易

1、本基金本报告期内(2012年4月25日至2012年6月30日)没有与关联方进行债券交易。

2、本基金于2012年4月25日成立,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.1.4 债券回购交易

1、本基金本报告期内(2012年4月25日至2012年6月30日)没有与关联方进行债券回购交易。

2、本基金于2012年4月25日成立,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

1、本基金本报告期内(2012年4月25日至2012年6月30日)无应支付关联方的佣金。

2、本基金于2012年4月25日成立,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年4月25日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,534,148.17
其中:支付销售机构的客户维护费	480,551.66

注:1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

2、本基金于2012年4月25日成立,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年4月25日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	255,691.32

注:1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

2、本基金合同于2012年4月25日生效,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

1、本基金本报告期内(2012年4月25日至2012年6月30日)没有与关联方进行银行间同业市场的的债券(含回购)交易。

2、本基金于2012年4月25日成立,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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 2012年4月25日至2012年6月30日
基金合同生效日(2012年4月25日)持有的基金份额	9,999,000.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减:期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	9,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.13%

注:本基金管理人于本期通过代销机构认购本基金,认购手续费1000元。

6.4.4.4.2 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	本期末 2012年6月30日		上年度末 2011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
南京证券	10,999,000.00	3.44%		-

6.4.4.5 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	本期 2012年4月25日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	127,297,879.58	261,751.27
交通银行定期存款	-	1,366,777.78

注:1、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。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2012年6月30日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示。

3、本基金合同于2012年4月25日生效,不存在"上年度可比期间"。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内及上年度可比期间内均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 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交易中作为抵押的债券。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,595,475.12	5.16
	其中:股票	17,595,475.12	5.16
2	固定收益投资	19,986,000.00	5.86
	其中:债券	19,986,000.00	5.86
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	118,600,671.90	34.80
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	182,494,615.69	53.55
6	其他资产	2,118,756.52	0.62
7	合计	340,795,519.23	100.00

注: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。

7.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,744,296.75	1.82
C0	食品、饮料?	1,510,240.00	0.48
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	126,762.20	0.04
C7	机械、设备、仪表	2,547,308.80	0.81
C8	医药、生物制品	1,559,985.75	0.49
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	579,212.00	0.18
F	交通运输、仓储业	891,276.72	0.28
G	信息技术业	20,904.00	0.01
H	批发和零售贸易	1,432,422.44	0.45
I	金融、保险业	3,937,371.21	1.25
J	房地产业	4,222,092.00	1.34
K	社会服务业	29,900.00	0.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	738,000.00	0.23
	合计	17,595,475.12	5.58

7.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000776	广发证券	73,671	2,197,605.93	0.70
2	600256	广汇能源	150,000	2,020,500.00	0.64
3	600239	云南城投	220,800	1,874,592.00	0.59
4	601788	光大证券	130,400	1,717,368.00	0.54
5	600153	建发股份	200,059	1,432,422.44	0.45
6	002294	信立泰	50,000	1,350,000.00	0.43
7	000858	五粮液	40,000	1,310,400.00	0.42
8	002564	张化机	101,000	1,232,200.00	0.39
9	600787	中储股份	100,369	891,276.72	0.28
10	000540	中天城投	100,000	738,000.00	0.23

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.fadfunds.com网站的半年度报告正文

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600256	广汇能源	18,469,808.57	5.86
2	000878	云南铜业	9,755,783.07	3.09
3	000629	攀钢钒钛	8,326,910.00	2.64
4	600787	中储股份	8,160,535.74	2.59
5	600271	航天信息	7,221,882.00	2.29
6	600036	招商银行	6,963,000.00	2.21
7	000776	广发证券	5,921,183.00	1.88
8	600545	新疆城建	5,893,437.85	1.87
9	002073	软控股份	5,494,939.80	1.74
10	600340	华夏幸福	5,321,903.00	1.69
11	600153	建发