富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2012】第三季度报告

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:2012年10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。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10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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2012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	193,954,461.38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	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×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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,616,935.72
2.本期利润	-8,054,088.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0352
4.期末基金资产净值	184,069,401.89
5.期末基金份额净值	0.949

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2012年4月25日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

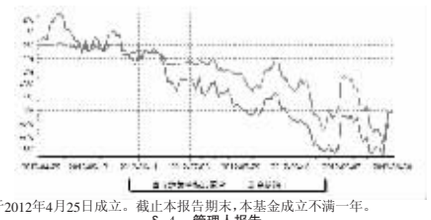
3.2 基金净值表现

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	-3.77%	0.70%	-3.36%	0.65%	-0.41%	0.05%

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



注: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。

§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		
黄强	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,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 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》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。
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
三季度市场依旧呈现弱市,上证综指下跌6.26%,沪深300指数下跌6.85%,主要原因为市场对经济增速持续下行感到担忧,对中长期增长动力缺乏信心,加上通胀见底滞后开始有所回升而央行在三季度不再降准也彻底打击了市场对货币宽松刺激的预期,PPI持续负数加上主要工业原材料价格期间有一次显著下跌都导致市场的持续下跌。本基金在三季度前期保持谨慎,始终以较低仓位运行,8月中旬以后(上证综指2100点)逐步加大仓位,且配置结构以哑铃型结构为主,即一端是医药食品饮料等稳健增长,一端是保险券商煤炭建材等高弹性板块的结构。这样的结构分布主要基于我们对主要工业原材料价格在7月初跌幅过大有心理情绪的因素在内的判断,同时我们观察到煤炭行业自身在供给端的调节能力相对优异且大部分民营和中小矿企已经开始了供给端的调节,而水泥行业在9月以后将迎来旺季有价格反弹的可能性;保险和券商作为非银行金融业,既可能受益于银行业信贷扩张受限的格局,更是金融机制改革的重点方向和直接融资大发展的受益标的。事后看,我们的逻辑是合理的,但在时点选择上还稍微偏早了一点,因此在8月末的市场下跌中基金遭受一定损失,也导致在9月末的反弹中未能以良好心态应对,未以较优价格兑现高弹性板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为0.9490元,本报告期份额净值增长率为-3.77%,同期业绩比较基准增长率为-3.36%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望年底,我们对宏观经济并不过于悲观,基本判断是中国经济能够在7-8%的经济增速维持5-10年,所以未来我们很可能看不到10%以上的经济增速但也不太容易出现6%以下的低速增长,除非政策失误或者全球大衰退。短期内我们认为中国经济将在7.5%的季度增速附近波动,经济的波幅相较前几年将大幅收窄,但稳定性能够体现,因为全社会总需求不可能无底线的下滑,均衡需求水平能够匹配相应的总供给。由于不太可能再采取特别强劲的刺激政策,经济即使向上力度也会低于过往,除非新的技术革命带来增长新动力。对于证券市场而言,我们仍旧维持相对谨慎的看法,短期的超跌反弹,政策红利不会改变宏观周期的趋势,也无法改变证券市场自身供求关系压力和一些体制性的矛盾。由于间接融资创造能力的受限,直接融资的压力前所未有的庞大,债券融资和股权融资在未来几年都会持续不断的对二级市场造成压力,大小非解禁的压力也会对二级市场形成一定压力,所以在没有增量资金供给的格局下市场估值不太可能大幅度提高。由于传统产业的产能过剩短期无法出清,所以周期性行业的盈利水平估计相对滚动,只有真正有技术优势和创新能力的部分企业能够脱颖而出享受高估值,而非周期性行业有可能呈现需要时间才能体现价值的格局。对于明年的企业盈利状况,我们预期会呈现低位回稳的状况,同比增速将好于今年,这一点从下半年的PPI环比数据已经可以看出一些端倪。这样的市场格局有可能导致市场换手率下降,对投资管理能力提出新的挑战。此外,如果证券行业创新取得突破和进展的话,有可能带来衍生工具市场的大发展,并对证券市场的盈利模式提出挑战。对此,基金管理人只能以更加敬畏的心态,更加谨慎严谨的研究分析,更加高效的投资交易能力才能更好的应对市场的挑战,为持有人获取收益。

§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	权益投资	97,164,219.38	52.19
	其中:股票	97,164,219.38	52.19
2	固定收益投资	19,942,000.00	10.71
	其中:债券	19,942,000.00	10.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,195.00	26.86
	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	18,665,354.40	10.03
6	其他各项资产	387,038.51	0.21
7	合计	186,158,807.29	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

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	2,506,200.00	1.36
C	制造业	58,475,554.27	31.77
C0	食品、饮料	10,253,112.90	5.57
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	7,680,100.00	4.17
C5	电子	9,697,347.28	5.27
C6	金属、非金属	6,953,207.03	3.78
C7	机械、设备、仪表	6,929,602.94	3.76
C8	医药、生物制品	16,962,184.12	9.22
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,264,390.00	0.69
E	建筑业	6,286,101.00	3.42
F	交通运输、仓储业	956,908.46	0.52
G	信息技术业	5,919,764.73	3.22
H	批发和零售贸易	2,420,689.01	1.32
I	金融、保险业	12,611,732.00	6.85
J	房地产业	2,802,392.97	1.52
K	社会服务业	3,491,291.94	1.90
L	传播与文化产业	426,000.00	0.23
M	综合类	3,195.00	-
	合计	97,164,219.38	52.79

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。

5.3 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

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	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	180,000	7,549,200.00	4.10
2	601601	中国太保	250,000	5,057,500.00	2.75
3	600887	伊利股份	200,000	4,260,000.00	2.31
4	600549	厦门钨业	100,969	4,078,137.91	2.22
5	600199	金种子酒	180,000	3,834,000.00	2.08
6	300128	锦富新材	219,959	3,501,747.28	1.90
7	002161	远望谷	450,000	3,483,000.00	1.89
8	600196	复星医药	300,000	3,207,000.00	1.74
9	002422	科伦药业	64,000	3,193,600.00	1.73
10	600329	中新药业	240,500	2,679,170.00	1.46

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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,942,000.00	10.83
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,942,000.00	10.83

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041269014	12大恒CP001	200,000	19,942,000.00	10.83

5.6 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。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 投资组合报告附注
5.8.1 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。
5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。
5.8.3 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	103,870.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	24,300.00
4	应收利息	244,340.98
5	应收申购款	14,526.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	387,038.51

5.8.4 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。
5.8.5 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

本报告期期初基金份额总额	319,796,308.91
本报告期基金总申购份额	200,121.00
减:本报告期基金总赎回份额	126,041,968.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	193,954,461.38

注: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。

§7 影响投资者决策的其他重要信息

2012-07-02 关于新增中国农业银行股份有限公司为富安达增强收益债券型证券投资基金代销机构的公告
2012-07-02 富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与中信建投证券股份有限公司网上交易系统申购及定期定额申购费率优惠活动的公告
2012-08-09 关于富安达基金管理有限公司新增办理基金转换业务机构的公告
2012-09-01 关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
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》
《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
8.2 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。
8.3 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○一二年十月二十五日

富安达优势成长股票型证券投资基金

【2012】第三季度报告

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:2012年10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。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10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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2012年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达优势成长股票
基金主代码	710001
交易代码	前端: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	389,021,268.69份
投资目标	本基金定位为股票型证券投资基金。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,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	本基金属于股票型证券投资基金,属于证券投资基金中预期风险和预计收益较高的基金产品。
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-16,134,491.99
2.本期利润	-23,772,497.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0603
4.期末基金资产净值	327,774,259.46
5.期末基金份额净值	0.8426

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。

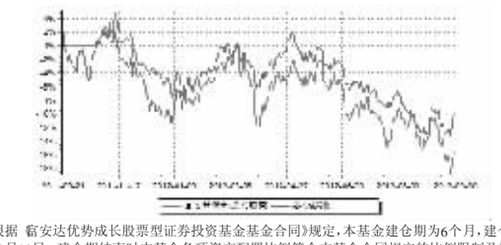
3.2 基金净值表现

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	-6.69%	1.21%	-4.90%	0.89%	-1.79%	0.32%

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



注:根据《富安达优势成长股票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		
孔学兵先生	本基金的基金经理、投资管理部副总监	2011年9月21日	-	16年	工商管理硕士。1996年加入南京证券有限责任公司,历任投资管理总部高级投资经理、资产管理总部高级投资经理。2010年1月加入富安达基金筹备组,2011年4月任富安达基金管理有限公司投资管理部副总监、投资决策委员会成员。

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、《富安达优势成长股票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》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。
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
三季度,国内市场经历了最艰难时刻的煎熬。经济持续下行叠加宽松预期落空,共同造就了A股市场2000点的"破冰之旅",周期类股反复探底之后,市场信心的崩溃引发了消费类股的补杀。
报告期内本基金总体维持了偏低仓位水平,重点减持了金融、地产、食品饮料,侧重配置于医药、消费电子、新兴产业等成长类股票。9月份,欧美货币宽松导致资源品价格波动,国内基建投资呈现加码迹象,本基金重点加大了对稀贵金属、机械制造等周期性品种的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2012年9月30日,本基金份额净值为0.8426元,本报告期份额净值增长率为-6.69%,同期业绩比较基准增长率为-4.9%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望四季度,国内宏观经济依然面临下行压力,中游制造业以及下游消费领域表现出来的需求仍然非常低迷。出口增长10%的年内目标较难实现,消费下行趋势有机会在四季度看见拐点,投资下行趋势能否见底回升尚待观察。值得期待的是,PMI等经济先行指标已经暗示,企业盈利低点可能在三季度,预计四季度开始弱上行,实体经济有望依赖自身韧性走过最黑夜,但尚需验证。
短期看,美国就业市场回暖与欧元区形势进一步明朗,叠加国内稳增长对冲政策的累积效应,有利于扭转市场此前的悲观预期,或将带动A股市场在超跌之后迎来反弹契机。中期看,决定A股市场走向的根本因素在于企业盈利自身的恢复和市场资金面的实质性改善。投资策略上,我们将密切关注经济数据变化与政策走向,中长期重点关注代表未来、符合转型方向的医药、食品、电子信息、环保、文化传媒等消费成长股,同时,努力把握好周期类股的估值修复机会。

§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	权益投资	252,581,939.82	73.24
	其中:股票	252,581,939.82	73.24
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	49,900,314.85	14.47
	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	35,543,612.84	10.31
6	其他各项资产	6,840,563.78	1.98
7	合计	344,866,431.29	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

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,427,400.00	2.88
B	采掘业	22,105,120.00	6.74
C	制造业	155,832,575.16	47.54
C0	食品、饮料	10,903,200.00	3.33
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	6,794,260.00	2.07
C5	电子	49,955,843.31	15.24
C6	金属、非金属	16,756,952.36	5.11
C7	机械、设备、仪表	32,393,957.56	9.88
C8	医药、生物制品	39,028,361.93	11.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,798,800.00	2.68
E	建筑业	10,224,697.59	3.12
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	14,450,264.82	4.41
H	批发和零售贸易	11,363,682.25	3.47
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	17,442,000.00	5.32
L	传播与文化产业	2,937,400.00	0.90
M	综合类	-	-
	合计	252,581,939.82	77.06

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	440,000	12,196,800.00	3.72
2	002106	莱宝高科	680,000	11,043,200.00	3.37
3	600059	古越龙山	840,000	10,903,200.00	3.33
4	000430	张家界	1,150,000	10,637,500.00	3.25
5	600549	厦门钨业	220,000	8,885,800.00	2.71
6	600157	永泰能源	1,000,000	8,740,000.00	2.67
7	600655	豫园商城	1,050,415	8,560,882.25	2.61
8	600479	千金药业	699,890	8,412,677.80	2.57
9	600993	马应龙	499,918	7,953,695.38	2.43
10	600763	通策医疗	310,000	6,804,500.00	2.08

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名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。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.8 投资组合报告附注
5.8.1 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。
5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。
5.8.3 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	2,250,000.00
2	应收证券清算款	4,547,773.10
3	应收股利	-
4	应收利息	34,800.92
5	应收申购款	7,989.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,840,563.78

5.8.4 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。
5.8.5 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

本报告期期初基金份额总额	399,974,289.92
本报告期基金总申购份额	755,728.71
减:本报告期基金总赎回份额	11,708,749.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	389,021,268.69

§7 影响投资者决策的其他重要信息

2012-07-02 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网上银行、手机银行申购基金业务费率优惠活动的公告
2012-08-09 关于富安达基金管理有限公司新增办理基金转换业务机构的公告
2012-09-01 富安达基金管理有限公司旗下基金通过上海长量基金销售投资顾问有限公司开通开放式基金转换业务、定期定额投资业务及相关申购费率优惠活动的公告
2012-09-01 关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
中国证监会批准富安达优势成长股票型证券投资基金设立的文件
《富安达优势成长股票型证券投资基金招募说明书》
《富安达优势成长股票型证券投资基金基金合同》
《富安达优势成长股票型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
8.2 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。
8.3 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○一二年十月二十五日

富安达增强收益债券型证券投资基金

【2012】第三季度报告

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:2012年10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。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10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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2012年7月25日(基金合同生效日)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7月25日	
报告期末基金份额总额	421,280,412.95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,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。本基金通过久期配置、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。	
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	
下属两级基金的基金简称	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属两级基金的份额总额	185,485,833.29	235,794,579.66

§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(2012年7月25日-2012年9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	606,362.89	902,842.83
2.本期利润	592,001.53	781,309.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0029	0.0020
4.期末基金资产净值	186,034,173.40	236,315,656.48
5.期末基金份额净值	1.0030	1.0022

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2012年7月25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
自基金合同生效日起至今(2012年07月25日-2012年09月30日)	0.30%	0.01%	-1.00%	0.13%	1.30%	-0.12%

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
自基金合同生效日起至今(2012年07月25日-2012年09月30日)	0.22%	0.01%	-1.00%	0.13%	1.22%	-0.