富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2013】第一季度报告

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：2013年4月22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2013年4月19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1月1日起至3月31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	71,018,435.35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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	16,244,862.02
2.本期利润	10,443,225.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0951
4.期末基金资产净值	75,014,091.39
5.期末基金份额净值	1.0563

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	7.80%	1.31%	-0.06%	0.85%	7.86%	0.46%

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，

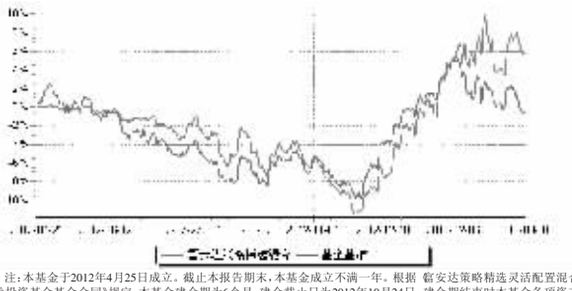
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

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。根据《富安达策略精选灵活配置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10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		
黄强	本基金的基金经理、公司研究发展部副总监	2012年4月25日	-	19年	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、助理总经理、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，中信基金管理有限公司上海分公司高级经理、副总裁，光大保德信基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、盲席策略分析师，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 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，监察稽核部分季度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，1分日、3日、5日和30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

2013年一季度，宏观经济经历小周期弱复苏之后，随着2月PMI的环比下滑、央行货币政策逐步转向中性、地产调控与影子银行清理整顿使得短期经济复苏的力度和持续性经受考验，市场对经济复苏的预期出现动摇，导致A股市场冲高回落，总体处于震荡探底格局。

报告期内本基金针对宏观层面与市场层面出现的新变化，投资策略进行了调整，大幅度减持了2012年四季度重点投资的以估值修复为核心的地产、建材、汽车等周期性行业，重点增持了装饰园林、环保、消费电子、医药等符合经济结构转型和内需升级要求的成长性个股。投资组合中部分个股表现较好，一定程度上对冲了地产等周期股年初以来持续调整对本基金净值可能带来的损害。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日，本基金份额净值为0.9095元，本报告期份额净值增长率为7.80%，同期业绩比较基准增长率为-0.06%。

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13年二季度，我们对宏观经济的前景判断比较谨慎，预计经济增长将会出现一些波折。首先，银监会监管新政的推出将导致影子银行融资渠道的收紧，银行短期内寻求规避方式上存在难度，而受制于非银机构净资本限制、私募性质下较高的投资门槛、较慢审批速度以及相对较弱的流动性管理能力，在短期很难得到弥补。在此背景下，社会融资总量的增速将放缓，信托贷款、委托贷款的增长会下降，基建投资的增速将受到抑制。另一方面，预计二季度出口增速平稳，外汇占款很难有大规模的增加；通胀虽然上半年不会成为主要问题，但央行也缺乏进一步宽松的意愿，预计将维持中性态度。因此二季度整体流动性局面应比一季度偏紧。此外，很多投资者有所期许的补库存也很难在二季度出现：从02至08年，由于国内需求旺盛，原材料价格持续上涨，中游企业可以通过较高的库存水平获得额外收益，但最近3至4年，原材料价格大幅震荡，单边上涨的局面不再，高库存并不能带来收益，因此目前中游企业补库存的意愿也大大减弱。房地产方面，预计二季度地产投资仍可保持较快的增速，地产商目前资金相对充足，地产投资也在在惯性，但地产调控政策对长期地产投资的增长仍然有所压制。在国五条导致刚需集中释放之后，我们更关注龙头地产公司容纳社会需求的能力和相对于行业而言的竞争优势。

证券市场方面，两会前处于政策蜜月期，市场对新政府推出改革政策的期望较大，股指也在年初快速上涨，风险厌恶情绪有所扭转；而在3月，随着地产政策以及银行理财监管政策的推出，市场意识到经济仍要经历转型期的阵痛，而改革政策在多方博弈中也很难较快推出，导致股指有所调整；在二季度经济复苏不确定性逐渐加大的背景下，预计股指将呈现震荡的格局，向上的空间不大。行业方面，我们更看好受益于改革红利、盈利稳定增长的医药、电子、食品等行业，但由于二季度中小板解禁市值较大，预计个股将出现分化。此外，我们预计二季度市场还将面对IPO重新开闸的考验，不过我们对于打包发行持欢迎态度，这将有利于提高市场的甄别能力和定价能力。对此，基金管理人将一如既往的恪守基金契约，以细致的研究、严谨的心态，精选个股、行业，力争在有效控制风险的情况下为投资者创造最大的价值。

§ 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	60,676,834.74	78.95
	其中：股票	60,676,834.74	78.95
2	固定收益投资	11,474,456.40	14.93
	其中：债券	11,474,456.40	14.93
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	4,391,658.24	5.71
6	其他各项资产	308,584.07	0.40
7	合计	76,851,533.45	100.00

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项与合计可能有尾差。

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	采矿业	14,040.00	0.02
C	制造业	50,761,324.74	67.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,554,500.00	3.41
F	批发和零售业	3,521,000.00	4.69
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	1,844,630.00	2.46
J	金融业	457,940.00	0.61
K	房地产业	865,900.00	1.15
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	657,500.00	0.88
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	60,676,834.74	80.89

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	600490	中科合臣	250,000	5,432,500.00	7.24
2	600312	平高电气	607,000	5,286,970.00	7.05
3	600521	华海药业	250,000	4,067,500.00	5.42
4	000028	国药一致	100,000	3,521,000.00	4.69
5	600597	光明乳业	190,000	2,699,900.00	3.60
6	002022	科华生物	180,000	2,662,200.00	3.55
7	002422	科伦药业	40,000	2,559,600.00	3.41
8	000063	中兴通讯	220,000	2,464,000.00	3.28
9	002415	海康威视	62,981	2,427,287.74	3.24
10	300155	安居宝	145,000	2,182,250.00	2.91

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	9,975,000.00	13.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,499,456.40	2.00
8	其他	-	-
9	合计	11,474,456.40	15.30

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	112141	12金王债	100,000	9,975,000.00	13.30
2	113002	工行转债	13,880	1,499,456.40	2.00

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

5.9.3 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	119,881.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	176,748.58
5	应收申购款	11,954.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	308,584.07

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	1,499,456.40	2.00

5.9.5 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	168,612,550.24
本报告期基金总申购份额	2,038,461.39
减：本报告期基金总赎回份额	99,632,576.28
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	71,018,435.35

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

2013/01/22 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2012年第4季度报告；

2013/02/22 富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司定期定额申购基金业务费率优惠活动的公告；

2013/02/22 富安达基金管理有限公司关于与易宝支付合作开通光大银行、建设银行、农业银行、中国银行、温州银行、工商银行、浦发银行、平安银行、兴业银行、交通银行及中信银行借记卡网上直销业务的公告；

2013/03/15 关于增加诺亚正行（上海）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及开通开放式基金网上申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告；

2013/03/26 富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠的公告；

2013/03/26 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2012年年度报告。

§ 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
二〇一三年四月二十二日

富安达现金通货币市场证券投资基金

【2013】第一季度报告

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：2013年04月22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2013年4月19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1月29日（基金合同生效日）起至3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	176,661,794.59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	81,712,340.75	94,949,453.84

§ 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01月29日-2013年03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	1,684,719.16	1,116,871.97
2.本期利润	1,684,719.16	1,116,871.97
3.期末基金资产净值	81,712,340.75	94,949,453.84

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

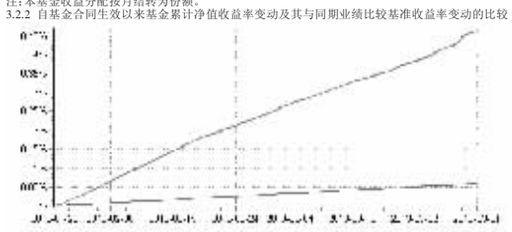
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日起至今(2013年01月29日-2013年03月31日)	0.4627%	0.0027%	0.0595%	0.0000%	0.4032%	0.0027%

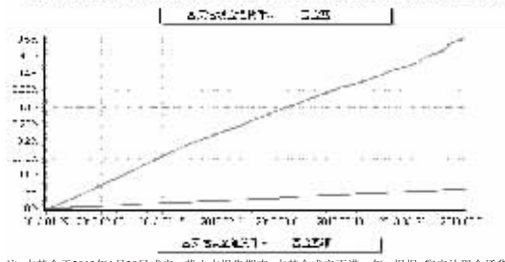
2、富安达现金通货币B

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
自基金合同生效日起至今(2013年01月29日-2013年03月31日)	0.5044%	0.0028%	0.0595%	0.0000%	0.4449%	0.0028%

注：本基金收益分配按月结转为份额。

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，截至报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 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	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》及其各项实施准则、《富安达现金通货币市场证券投资基金合同》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》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起，监察稽核部分季度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，1分日、3日、5日和30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

报告期内市场资金面较为宽松，银行间7天回购利率维持在3%-3.3%附近，短端利率在较大程度上反映了资金面状况，一季度末债券收益率有明显下行。我们通过对宏观经济以及短期货币市场利率走势的判断，在产品成立初期以较好的收益率配置了一些流动性较好的中等评级短期融资券，较好分享了本轮债券上涨行情，实现了较好的波段操作，此外还通过回购和存款的配置取得了较为稳定的投资回报。报告期内，本基金整体规模波动较大，我们根据投资者的申购赎回情况对组合中各类资产的配置做了合理安排，以保证本基金的流动性。

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0.4627%，富安达现金通货币B份额净值收益率为0.5044%，同期业绩比较基准收益率为0.35%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

第一季度市场资金面处于较为宽松状态；银监会2013年8号文出台后释放了大量债券配置需求，而债券供给相对较少；受到季节性回落和短期因素影响，3月份CPI同比增速为2.1%，低于市场预期；这几项因素短期内都对债券市场形成利好，我们预计债券收益率水平仍有下行空间。本基金在下一阶段将持续关注资金利率水平以及短期信用债券的走势，及时把握债券小牛市带来的交易机会，通过短久期策略筛选合适的短期债券品种，并利用资金利率波动情况对存款和回购资产进行动态配置。

本货币基金将继续把流动性管理和风险控制放在首要位置，坚持规范运作。在基金运作中，根据经济基本面及政策面的变化情况、以及基金的申购赎回情况进行资产组合的动态优化调整，把握好流动性、收益性和风险性三者的平衡，在维持流动性和安全性的前提下力争获得较高的收益。

§ 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	固定收益投资	60,378,945.22	34.13
	其中：债券	60,378,945.22	34.13
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	107,000,759.00	60.49
	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	8,121,763.43	4.59
4	其他资产	1,399,798.50	0.79
5	合计	176,901,266.15	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	1.52
	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	60
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

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	65.17	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	5.71	-
	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	17.10	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	11.36	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.34	-

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	10,011,028.64	5.67
	其中：政策性金融债	10,011,028.64	5.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,367,916.58	28.51
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	60,378,945.22	34.18
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和溢折价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

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	041259027	12晋能源CP001	100,000	10,086,829.08	5.71
2	041260054	12铁十五CP002	100,000	10,073,322.95	5.70
3	041253050	12辽成大CP002	100,000	10,073,104.17	5.70
4	041261032	12金元CP001	100,000	10,068,882.03	5.70
5	041259064	12桂新发CP001	100,000	10,065,778.35	5.70
6	120419	12农发19	100,000	10,011,028.64	5.67

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	0.0123%
报告期内偏离度的最低值	-0.0095%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0036%

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固定单位价值交易方式，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。

5.8.4 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	1,349,698.50
4	应收申购款	50,100.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	1,399,798.50

§ 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
基金合同生效日基金份额总额	605,313,583.32	388,710,832.80
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	18,308,691.70	94,535,561.66
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	541,909,934.27	388,296,940.62
本报告期期末基金份额总额	81,712,340.75	94,949,453.84

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 影响投资者决策的其他重要信息

2013/01/10 富安达现金通货币市场证券投资基金基金合同摘要；

2013/01/10 富安达现金通货币市场证券投资基金基金托管协议；

2013/01/10 富安达现金通货币市场证券投资基金基金合同；

2013/01/10 富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书；

2013/01/10 富安达现金通货币市场证券投资基金基金份额发售公告；

2013/01/16 关于新增江苏银行股份有限公司为富安达现金通货币型证券投资基金代销机构的公告；

2013/01/16 关于新增中银万国证券股份有限公司为富安达现金通货币型证券投资基金代销机构的公告；

2013/01/23 关于新增国信证券股份有限公司为富安达现金通货币市场证券投资基金代销机构的公告；

2013/01/23 关于新增中信万通证券有限责任公司为富安达现金通货币市场证券投资基金代销机构的公告；

2013/01/23 关于新增中国农业银行股份有限公司为富安达现金通货币市场证券投资基金代销机构的公告；

2013/01/30 富安达现金通货币市场证券投资基金基金合同生效公告；

2013/02/08 富安达现金通货币市场证券投资基金开放日常申购和赎回业务公告；

2013/02/18 富安达现金通货币市场证券投资基金封闭期收益公告；

2013/02/21 富安达现金通货币市场证券投资基金开放转换、定期定额投资业务公告；

2013/02/22 富安达基金管理有限公司关于与易宝支付合作开通光大银行、建设银行、农业银行、中国银行、温州银行、工商银行、浦发银行、平安银行、兴业银行、交通银行及中信银行借记卡网上直销业务的公告；

2013/03/15 关于增加诺亚正行（上海）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及开通开放式基金网上申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告；

2013/03/26 富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠的公告；

2013/03/25 富安达基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下基金的公告。

§ 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现金通货币型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