

富安达现金通货币市场证券投资基金

2013 第二季度报告

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投资基金合同》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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张瑞琳	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经理;爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员、硕士研究员,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,其离任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方法的相关规定。

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系统,涵盖了所有投资组合,并贯穿分授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公司对特指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》。

按照管理人旗下第二个投资组合成立之日起,重新核算前季度对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,投资组合之间,1月1日至3月31日和3月31日至6月30日期间方向同向存在价格差异的情况,通过对各投资组合6月3日及前一个交易日组合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 报告期内本基金的投资策略和运作分析
报告期内市场波动较大,4月份受到债市整顿风波影响,市场转入小微债市;随后5月份在资金面较为宽松的背景下短债市场继续被市场一波上行情,而6月份受到银行间市场“钱荒”影响,资金利率飙升,加重了融资成本,同时短债利率亦大幅上行。在报告期内,我们积极券实现了较好的波段操作,根据基金规模变动情况对组合中债券及回购等资产做了合理配置,较好的保持了本基金的流动性,收益率总体表现为稳定。

4.5 报告期内本基金的投资表现
本报告期内富安达现金通货币A份额净值收益率为0.7932%,富安达现金通货币B份额净值收益率为0.8534%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

4.6 管理人应对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
二季度全球经济复苏,国内宏观经济复苏乏力,通胀处于可控区间,预计三季度资产价格不会像二季度大起大落,由于短期债券的走势主要取决于资金面和政策的变化,在今年资金面逐步宽松,资金面难以进一步改善的背景下,我们对下半年债券市场总体偏谨慎。同时信用风险会随着地方政府和企业资金压力的上升而上升,不排除一些债券会被下调评级的可能。未来下一阶段将重点关注中高评级短期信用债券,并利用资金利率波动情况对回购等资产进行动态配置。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	70,113,687.70	59.58
	其中:债券	70,113,687.70	59.58
2	货币支持证券	-	-
3	买入返售金融资产	42,750,384.13	36.33
	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	3,337,680.72	2.85
4	其他资产	1,461,660.99	1.24
5	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金总资产比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,919,457.63	54.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,109,702.40	1.73
F	批发和零售业	-	-
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	5,365,630.37	8.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,268,200.00	6.64
L	租赁和商务服务业	31,960.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	2,482,470.00	3.86
N	水利、环境和公共设施管理业	1,414,400.00	2.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
R	卫生和社会工作	-	-
S	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	49,591,820.40	77.20

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名的前十名股票投资明细

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	300074	华平股份	203,000	3,674,300.00	5.72
2	002655	信达地产	400,000	3,460,000.00	5.39
3	600517	置信电气	245,000	3,454,500.00	5.38
4	600312	康达新材	350,000	2,227,000.00	5.02
5	300273	和顺股份	140,000	2,998,800.00	4.67
6	002241	歌尔声学	77,000	2,794,330.00	4.35
7	002466	华升铝业	77,913	2,642,808.96	4.11
8	002308	威视股份	272,450	2,506,540.00	3.90
9	002317	众泰药业	100,000	2,197,000.00	3.42
10	600340	华夏证券	60,000	1,952,400.00	3.04

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	中期票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	9,948,400.00	15.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	9,948,400.00	15.49

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十名债券投资明细

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	9,948,400.00	15.49

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交易情况说明
5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.2 本基金投资国债期货的投资政策

5.10 本基金投资资产支持证券的情况
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
黄强	本基金的基金经理、公司研究发展部总监	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总经理,助理总经理,研究所策略分析师,泰信基金管理有限责任公司投资管理部副经理,中信基金管理有限责任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,目前就职于富安达基金管理有限公司,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍

注:1、基金经理任职日期自其担任基金管理人决定正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,其任职日期为基金合同生效日,其离任日期及公司作出决定后正式对外公告之日;

4.2 管理人在报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
《中华人民共和国证券投资基金法》、《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系统,涵盖了所有投资组合,并贯穿分授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公司对特指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》。

按照管理人旗下第二个投资组合成立之日起,重新核算前季度对各基金公平交易执行情况进行了统计分析,投资组合之间,1月1日至3月31日和3月31日至6月30日期间方向同向存在价格差异的情况,通过对各投资组合6月3日及前一个交易日组合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 报告期内本基金的投资策略和运作分析
报告期内市场波动较大,4月份受到债市整顿风波影响,市场转入小微债市;随后5月份在资金面较为宽松的背景下短债市场继续被市场一波上行情,而6月份受到银行间市场“钱荒”影响,资金利率飙升,加重了融资成本,同时短债利率亦大幅上行。在报告期内,我们积极券实现了较好的波段操作,根据基金规模变动情况对组合中债券及回购等资产做了合理配置,较好的保持了本基金的流动性,收益率总体表现为稳定。

4.5 报告期内本基金的投资表现
本报告期内富安达现金通货币A份额净值收益率为0.7932%,富安达现金通货币B份额净值收益率为0.8534%,同期业绩比较基准收益率为0.0873%。

4.6 管理人应对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
二季度全球经济复苏,国内宏观经济复苏乏力,通胀处于可控区间,预计三季度资产价格不会像二季度大起大落,由于短期债券的走势主要取决于资金面和政策的变化,在今年资金面逐步宽松,资金面难以进一步改善的背景下,我们对下半年债券市场总体偏谨慎。同时信用风险会随着地方政府和企业资金压力的上升而上升,不排除一些债券会被下调评级的可能。未来下一阶段将重点关注中高评级短期信用债券,并利用资金利率波动情况对回购等资产进行动态配置。

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 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股票投资明细

5.4 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债券投资明细

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十名资产支持证券投资明细

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五名权证投资明细

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10 本基金投资资产支持证券的情况

5.11 报告期末基金资产组合情况

5.12 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.13 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股票投资明细

5.14 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债券投资明细

5.15 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

5.16 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

5.17 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.18 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.19 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.20 本基金投资资产支持证券的情况

5.21 报告期末基金资产组合情况

5.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.23 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股票投资明细

5.24 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债券投资明细

5.25 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

5.26 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

5.27 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.28 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.29 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.30 本基金投资资产支持证券的情况

5.31 报告期末基金资产组合情况

5.32 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.33 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股票投资明细

5.34 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债券投资明细

5.35 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

5.36 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

5.37 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.38 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.39 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.40 本基金投资资产支持证券的情况

5.41 报告期末基金资产组合情况

5.42 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.43 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股票投资明细

5.44 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债券投资明细

5.45 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

5.46 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

5.47 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.48 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.49 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.50 本基金投资资产支持证券的情况

5.51 报告期末基金资产组合情况

5.52 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.53 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股票投资明细

5.54 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债券投资明细

5.55 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

5.56 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

5.57 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.58 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.59 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.60 本基金投资资产支持证券的情况

5.61 报告期末基金资产组合情况

5.62 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.63 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股票投资明细

5.64 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债券投资明细

5.65 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

5.66 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

5.67 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.68 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.69 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.70 本基金投资资产支持证券的情况

5.71 报告期末基金资产组合情况

5.72 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.73 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股票投资明细

5.74 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债券投资明细

5.75 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

5.76 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

5.77 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.78 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.79 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.80 本基金投资资产支持证券的情况

5.81 报告期末基金资产组合情况

5.82 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.83 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股票投资明细

5.84 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债券投资明细

5.85 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

5.86 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

5.87 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.88 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.89 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.90 本基金投资资产支持证券的情况

5.91 报告期末基金资产组合情况

5.92 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.93 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股票投资明细

5.94 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债券投资明细

5.95 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

5.96 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

5.97 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.98 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.99 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.100 本基金投资资产支持证券的情况

5.101 报告期末基金资产组合情况

5.102 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.103 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股票投资明细

5.104 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债券投资明细

5.105 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

5.106 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

5.107 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.108 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.109 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.110 本基金投资资产支持证券的情况

5.111 报告期末基金资产组合情况

5.112 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.113 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股票投资明细

5.114 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债券投资明细

5.115 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

5.116 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

5.117 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.118 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.119 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明