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
送出日期:2014年03月29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】年度报告摘要

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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2014年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2013年10月25日起至12月31日止。本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金	
基金简称	富安达信用纯债债券发起式	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	99,544,133.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达信用主题A	富安达信用主题C
下属分级基金的交易代码	000284	000285
报告期末下属分级基金的份额总额	40,242,389.41份	59,301,744.23份

2.2 基金产品说明

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,根极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。 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
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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋晓刚	李芳菲
	联系电话	021-61870999	010-66060069
	电子邮箱	service@fadfunds.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-630-6999(免长途)021-61870666	95559
传真		021-61870888	010-63201816
注册地址		上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200122	100031
法定代表人		张华东	蒋超良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年	2013年
	富安达信用主题A	富安达信用主题C
本期已实现收益	1,515,237.06	2,873,662.99
本期利润	1,519,106.31	2,881,220.15
加权平均基金份额本期利润	0.0084	0.0074
本期基金加权平均净值利润率	0.83%	0.74%
本期基金份额净值增长率	0.99%	0.82%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2013年末
期末可供分配利润	395,169.46	486,273.67
期末可供分配基金份额利润	0.0098	0.0082
期末基金资产净值	40,639,287.16	59,790,561.93
期末基金份额净值	1.0099	1.0082
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	0.99%	0.82%

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2013年10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 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

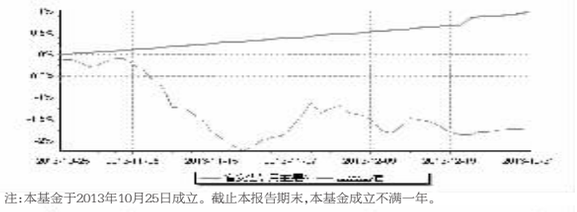
阶段(富安达信用主题A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.99%	0.02%	-1.75%	0.15%	2.74%	-0.13%
自基金合同生效日起至今(2013年10月25日-2013年12月31日)	0.99%	0.02%	-1.75%	0.15%	2.74%	-0.13%

注:①本基金业绩比较基准为:中债总财富总指数,
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 =中债总财富总指数t / 中债总财富总指数(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。

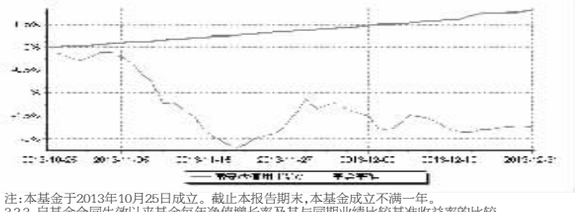
阶段(富安达信用主题C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.82%	0.01%	-1.75%	0.15%	2.57%	-0.14%
自基金合同生效日起至今(2013年10月25日-2013年12月31日)	0.82%	0.01%	-1.75%	0.15%	2.57%	-0.14%

注:①本基金业绩比较基准为:中债总财富总指数,
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 =中债总财富总指数t / 中债总财富总指数(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

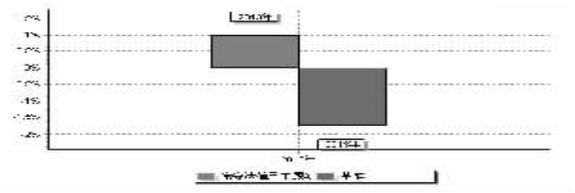


注:本基金于2013年10月25日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

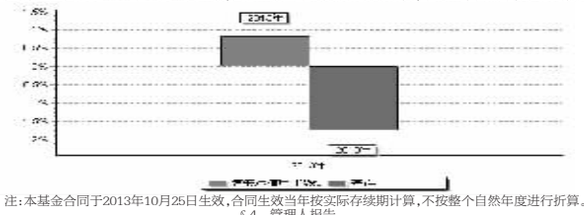


注:本基金于2013年10月25日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2013年10月25日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。



注:本基金合同于2013年10月25日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

§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由南京证券股份有限责任公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司三家单位共同发起设立。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦,注册资本2.88亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念,以基金持有人利益最大化为首要经营目标,为客户提供卓越的理财服务。

截至2013年12月31日,公司共管理五只开放式基金:富安达优势成长股票型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金通货币市场证券投资基金和富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金。

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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李飞先生	本基金的基金经理、富安达增强收益债券型证券投资基金基金经理	2013年10月25日	-	11年	历任上海技术应用技术学院财政经济系教师;聚源数据有限责任公司研究发展中心项目经理;国盛证券有限责任公司投资研究部高级宏观债券研究员;金元惠理基金管理有限公司投资部基金经理,博士研究生,具有基金从业资格,中国国籍
张凯瑜女士	本基金的基金经理、富安达现金通货币市场证券投资基金基金经理	2013年10月25日	-	6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、任职日期和离任日期均指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,任职日期为基金合同生效日。

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、《富安信用主题轮动纯债债券型发起式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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年国内经济总体平稳,世界经济温和复苏,通胀预期稳定。债券市场受制于资金价格的时点性扰动和非标市场的分流,出现了四年来首度下跌。本基金于2013年10月下旬募集成立。建仓初期时近年关,我们判断资金价格有走高可能,虽然债券收益率经过二季度的深度调整,已经具备较好的配置价值,但是从风险控制的角度出发,我们还是主要以银行协议存款和交易逆回购为主,并对短久期的国债做了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,富安达增强收益债券A基金份额净值为1.0140元,本报告期净值增长率为1.4%;富安达增强收益债券C基金份额净值为1.0121元本报告期净值增长率为1.21%,同期业绩比较基准增长率为0.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对2014年债券市场的基本判断是谨慎乐观。从经济基本面的角度看,通胀在2014年有望保持平稳,高点不会超过3.2%,在上游大宗品价格走软和国内需求下滑的背景下,温和的通胀数据不会对债市构成威胁。而2014年的经济增速有望平稳回落到7.5%附近,主要是总需求的放缓,地产投资走软、各地环境大气治理将拉低对汽车消费和工业生产,而2013年融资成本的高企也使得企业推迟新开工,均对经济构成制约。随着美欧日经济的复苏,2014年中国面临较好的外需环境,净出口对经济的边际贡献将跃升,贸易顺差和外汇占款有望阶段性走高,提升国内债市的流动性水平,在去年二度钱荒对国内银行风险管理敲山震虎后,银行有望纠正资产错配的偏差,更加前瞻性地做好流动性管理,保持较高的超储水平,因此央行在今年通过提高资金价格倒闭银行纠偏的非典型性政策出台的可能性不大。相反,在经济增长下滑情况下,法定准备金率有望下调。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设,强化内部管理,不断提升自身合规风控能力。报告期内,公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程,强化内控基础建设;牵头开展了多形式的合规培训,强化员工职业道德教育和合规意识培育,从源头上防范合规风险;建立健全防控内幕交易机制,确保基金投资的独立性、公平性和合规性;加强业务日常合规审核和合规监测,并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查,确保各项法规和管理制度有效落实,使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规,有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,建立健全全面风险管理体系,不断提高监察稽核工作的科学性和有效性,最大限度地防范和化解经营风险,充分保护基金份额持有人的合法权益。

4.7 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以及其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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期未进行收益分配。

§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

2013年度,基金托管人在富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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

2013年度,富安达基金管理有限公司在富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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、基金份额申购赎回的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

3、本基金合同于2013年10月25日生效,本期数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年10月25日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	210,669.08

注:1.支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

2.本基金合同于2013年10月25日生效,本期数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年10月25日至2013年12月31日		
	富安达信用主题A	富安达信用主题C	合计
富安达基金管理有限公司	-	-	-
农业银行股份有限公司	-	258,999.43	258,999.43
南京证券股份有限公司	-	27,855.30	27,855.30
合计		286,854.73	286,854.73

注:1.支付基金销售机构的信用主题纯债C类销售服务费按前一日信用主题纯债C类基金资产净值0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给富安达基金,再由富安达基金计算并支付给各基金销售机构。信用主题纯债A类不收取销售服务费。其计算公式为:日销售服务费=前一日信用主题纯债C类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

2.本基金合同于2013年10月25日生效,本期数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告内未与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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:人民币元

项目	本期 2013年10月25日至2013年12月31日	
	富安达信用主题A	富安达信用主题C
基金合同生效日持有的基金份额	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	24.85%	-

7.4.8.4.2 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:人民币元

关联方名称		本期末 2013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
富安达信用主题A	南京证券股份有限公司	9999000	24.85%

7.4.8.5 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 2013年10月25日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	10,365,634.03	62,619.39
中国农业银行定期存款		

注:1.本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管,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“农业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2013年12月31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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金2013年10月25日(基金合同生效日)至2013年12月31日期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.10 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未因认购新股/新债而持有流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本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。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	5,033,509.60	4.01
	其中:债券	5,033,509.60	4.01
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	58,900,288.35	46.97
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,628,205.79	8.48
7	其他各项资产	50,843,456.32	40.54
8	合计	125,405,460.06	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期内未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期内未卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	-
卖出股票收入(成交)总额	-

注:本基金本报告期内未买卖股票。

8.5 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	5,033,509.60	5.01
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,033,509.60	5.01

8.6 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	019302	13国债02	50,320	5,033,509.60	5.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	2,969.31
2	应收证券清算款	50,654,586.74
3	应收股利	-
4	应收利息	185,800.27
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,843,456.32

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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。

8.12.6 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,分项之和与合计之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
富安达信用主题A	965	41,701.96	20,575,532.43	51.13%	19,666,856.98	48.87%
富安达信用主题C	685	86,571.89	3,500,040.00	5.90%	55,801,704.23	94.10%
合计	1,650	60,329.78	24,075,572.43	24.19%	75,468,561.21	75.81%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	富安达信用主题A	-	-
	富安达信用主题C	-	-
	合计	-	-

1.基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0。

2.本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

9.3 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,000.00	10.04%	9,999,000.00	10.04%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	9,999,000.00	10.04%	19,999,000.00	20.09%	
其他	-	-	-	-	
合计	19,998,000.00	20.08%	29,998,000.00	30.13%	

注:本基金发起式资金提供方仅为基金管理人,公司股东和从业人员认购的基金份额不属于发起式份额。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	富安达信用主题A	富安达信用主题C
基金合同生效日(2013年10月25日)基金份额总额	200,309,769.85	428,666,060.41
本报告期期初基金份额总额	-	-
本报告期期间基金总申购份额	13,178.64	14,988.29
减:报告期期间基金总赎回份额	160,080,559.08	369,379,304.47
本报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,242,389.41	59,301,744.23

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金管理人的重大人事变动:

1.经富安达基金管理有限公司第一届董事会第十五次会议审议通过,同意李剑锋先生因工作调动原因辞去公司总经理职务,并决定自2013年5月23日起由副总经理蒋晓刚先生代为履行总经理职务;经富安达基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过,聘任蒋晓刚同志为富安达基金管理有限公司总经理。本基金管理人已于2013年5月28日、2013年10月15日分别在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了富安达基金管理有限公司高级管理人变更的公告。总经理变更事项已向中国证券监督管理委员会和上海监管局报告,经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1288号文核准批复。

2.经富安达基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过,聘任朱龙芳女士担任公司副总经理。本基金管理人已于2013年8月20日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《富安达基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告》。上述变更事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案,于2013年8月19日由中基协高备函(2013)62号文件确认备案。

3.经富安达基金管理有限公司第一届董事会第十七次会议审议通过,同意董事长张华东同志因已届法定退休年龄辞去董事长(法定代表人)职务,提名秦雁同志为公司董事会董事长(法定代表人),自中国证监会核准法定代表人之日起生效。截止报告日,该事项已上报中国证监会,正在待批过程中。副董事长步国旬先生、董事李剑锋先生辞去董事职务,新增董事秦雁先生、张丽琨女士。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为60,000元人民币。

截至本报告期末,该事务所已向本基金提供1年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人未受到任何稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
南京证券	1	-	-	-	-	

注:①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

(一)财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生;

(二)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(三)能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他信息咨询服务;

(四)能根据公司特定要求,提供专门研究报告;

(五)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务;能够提供很好的交易执行。

②券商专用交易单元选择程序:

(一)券商席位由投资管理部与研究发展部业务人员推荐,经投资管理部、研究发展部部门会议讨论,形成重点评估的券商备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

(二)投资管理部、研究发展部全体业务人员遵照券商选择标准的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成券商排名及专用席位租用意见,报公司总经理批准。

(三)公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议,明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等,经签章有效。

(四)若签约券商的服务不能满足要求,或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚,公司可以提前终止签署的协议,并撤销租用的席位。

③本报告期新增海通证券为本基金交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
南京证券	99,710,520.82	100.00%	127,400,000.00	100.00%	-	-

注:①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

(一)财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生;

(二)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(三)能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他信息咨询服务;

(四)能根据公司特定要求,提供专门研究报告;

(五)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理基金进行证券交易的需要,并能为基金提供全面的信息服务;能够提供很好的交易执行。

②券商专用交易单元选择程序:

(一)券商席位由投资管理部与研究发展部业务人员推荐,经投资管理部、研究发展部部门会议讨论,形成重点评估的券商备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

(二)投资管理部、研究发展部全体业务人员遵照券商选择标准的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成券商排名及专用席位租用意见,报公司总经理批准。

(三)公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议,明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等,经签章有效。

(四)若签约券商的服务不能满足要求,或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚,公司可以提前终止签署的协议,并撤销租用的席位。

③本报告期新增海通证券为本基金交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

富安达基金管理有限公司
二〇一四年三月二十九日