富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2015】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:2016年3月26日

§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2016年3月26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。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金
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	106,101,406.86
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,在安全控制风险的前提下,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	在宏观研究方面采用定性分析与定量分析相结合的基本面研究方法,通过对经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平等动态趋势,资金供求关系和市场估值的分析,结合PEG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。
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。

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	刘海	海葳葆
	联系电话	021-61870999	96659
	电子邮箱	service@fadfunds.com	tanguyi@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999(免长途)021-61870666	96659
传真		021-61870888	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

§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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	-189,295,687.64	9,593,628.33	24,677,561.97
本期利润	-193,840,436.33	11,921,982.78	12,687,708.75
加权平均基金份额本期利润	-1.7381	0.2827	0.1773
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	-0.6147	0.2561	-0.0077
期末基金资产净值	199,641,734.65	56,669,166.81	59,682,768.70
期末基金份额净值	1.8816	1.2561	0.9923
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	96.07%	30.12%	2.87%

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中已实现部分的余额数。

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
过去三个月	19.53%	1.62%	9.92%	0.92%	9.61%	0.70%
过去六个月	-12.79%	3.06%	-7.13%	1.47%	-5.66%	1.58%
过去一年	49.92%	3.06%	7.82%	1.37%	42.10%	1.69%
过去三年	99.07%	2.14%	35.33%	0.98%	63.74%	1.16%
自基金合同生效日起至今(2012年04月25日-2015年12月31日)	95.07%	1.94%	34.75%	0.93%	60.32%	1.01%

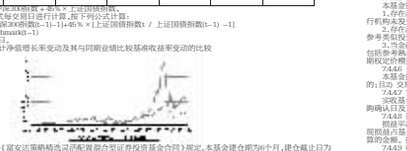
注1.本基金业绩比较基准为:65%×沪深300指数+35%×上证国债指数。

2.本基金的业绩基准数据按照相建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Benchmark t =(1+Return t)*(沪深300指数(t-1)-1)+35%*(上证国债指数(t-1)-1)

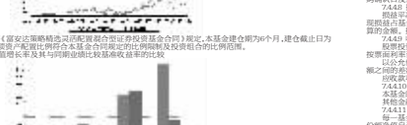
其中,t=1,2,3,…T,T表示时期长度

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,根据《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金合同》规定,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2012年10月24日。建仓期结束时基金各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。

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2012年4月25日成立,自成立日至年度末不足一个完整会计年度,按照实际存续期计算。

§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100号环球金融中心,注册资本人民币1亿元,公司秉承诚信、稳健、高效、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2015年12月31日,公司管理下三只开放式基金:富安达优势成长混合型证券投资基金、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,富安达现金货币市场证券投资基金,富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达新趋势灵活配置混合型证券投资基金、富安达新趋势灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金投资总监)及基金投资决策委员会

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		
黄国先生	本基金的基金经理、公司研究发展部总监	2012年4月25日	2015年8月11日	21年	历任浙江财政证券公司投资一部投资经理,光大证券有限公司资产管理部投资经理、资管总经理、研究所策略分析师、泰信基金管理有限公司投资决策委员会委员、光大保德信基金管理有限公司高级研究员、鹏元基金管理有限公司高级研究员、上海分公司高级经理、鹏元基,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,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍,法学硕士。
毛矛	本基金的基金经理、富安达建源人生灵活配置混合型证券投资基金基金经理、公司研究发展部高级研究员	2015年8月12日	-	9年	历任中信资源(香港)有限公司交易员;助理研究员各投资有限公司投资分析师;光大保德信基金管理有限公司行业研究员;富安达基金管理有限公司高级行业研究员兼基金经理,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍,法学硕士。

注1:上述任职期限按证券监管机构核准的任职日期和决定离任日期填写。

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投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他法规及基金合同等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。

本基金管理人在报告期内没有基金合同的约定。

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、并贯穿公司投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下所有一个投资组合。

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、并贯穿公司投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待旗下所有一个投资组合。

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,分日、2日、5日和10日时间段分析同向交易中在价格和时长上,是否存在不合理的差异。本报告期内,公司旗下投资组合所以及单个组合不同投资组合的投资决策的组合形成指令发出至价格成交的时间段内,因此不构成潜在利益输送的显著差异。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内本基金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

2015年全年市场整体呈现上涨趋势,但分化明显,创业板指数涨幅超过80%,沪深300涨幅只有不到5%,同时各种主题概念盛行,整体来看,小市值、高估值的个股表现较好,大类资产配置方面,由于我们主要以个股选股的配置,同时在固定收益方面,本基金合同规定的投资范围,组合的债券,获得了一定的收益。权益类配置中,我们上半年集中于中小盘成长股,下半年出于对市场风险偏好改变的预期,以均衡配置为主。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.8816元,本报告期份额净值增长率为49.92%,同期业绩比较基准收益率为7.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,市场的整体表现可能不及2015年,但分化特征明显。2015年市场涨幅显著,偏热上证指数仅上涨10%左右,但创业板指数接近翻倍,个股平均涨幅也超过50%。市场表现上的结构性的基础是宽松的流动性环境,1年以来央行共5次降息降息,基准存贷款利润能达了1.25%,10年期国债收益率在四季度也跌破3%,而10年前,由于美国加息,中美息差进一步缩小,资本外流无一不彰显当时压力较大,央行在16年再次多次降息的概率较小,整体宏观流动性的边际改善幅度预计将不如15年。会打出市场整体表现有一定影响,行业及个股方面,16年市场呈现两极分化的格局,新兴行业,中小市值公司表现较好,而传统行业中也会有一些可以跨越周期的行业,公司股票而言,本来我们将努力挖掘价值,控制成本,争取为持有人带来良好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照证券监督部、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部门负责人担任委员,估值委员会负责组织制定和调整估值基金估值政策和程序,指导和监督各个估值岗位,估值委员会人员具有证券、基金从业资格,具备相关法律法规,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执行。

本报告期内,参与估值流程各方了闭不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人以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

本报告期未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§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

2015年度,基金托管人在安交所、深证所等证券交易所进行基金的托管过程中,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,履行了应尽的义务,不存在任何因重大过失造成基金资产损失的情况,也不存在因内部管理原因造成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

2015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、基金费用开支等环境上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内未发现基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015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投资基金的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 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。注册会计师陈玲、沈光杰于2016年3月24日签字出具了普华永道中天审字(2016)第22242号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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:2015年12月31日

单位:人民币元

姓名	附注号	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
资产:					
银行存款	7.4.7.1		11,354,083.39		1,359,100.30
结算备付金			22,725,027.82		3,118,325.40
存出保证金			436,187.12		64,354.69
交易性金融资产	7.4.7.2		149,061,756.52		53,874,816.45
其中:股票投资			149,061,756.52		45,397,916.45
基金投资			-		-
债券投资			-		8,476,900.00
资产支持证券投资			-		-
贵金属投资			-		-
衍生金融资产	7.4.7.3		-		-
买入返售金融资产	7.4.7.4		10,000,000.00		-
应收证券清算款			12,713,456.63		-
应收利息	7.4.7.5		12,888.14		9,725.00
应收股利			-		-
应收申购款			8,825.53		33,800.52
递延所得税资产			-		-
其他资产	7.4.7.6		-		-
资产总计			206,312,224.15		58,460,122.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
负 债:					
短期借款			-		-
交易性金融负债			-		-
衍生金融负债	7.4.7.3		-		-
卖出回购金融资产款			-		-
应付证券清算款			3,521,919.40		871,132.07
应付赎回款			620,150.79		131,101.90
应付管理人报酬			280,134.46		69,138.86
应付托管费			43,355.72		11,523.14
应付销售服务费			-		-
应付交易费用	7.4.7.7		1,612,591.95		197,840.60
应交税费			-		-
应付利息			-		-
应付利润			-		-
递延所得税负债			-		-
其他负债	7.4.7.8		612,337.17		510,218.18
负债合计			6,670,489.50		1,790,956.55
所有者权益:					
实收基金	7.4.7.9		106,101,406.86		45,151,605.19
未分配利润	7.4.7.10		93,540,328.79		11,517,561.62
所有者权益合计			199,641,734.65		56,669,166.81
负债和所有者权益合计			206,312,224.15		58,460,122.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.8816元,基金份额总额106,101,406.86份。

7.2 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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一.收入		-185,172,685.49	14,047,533.58
1.利息收入		712,446.16	157,088.46
其中:存款利息收入	7.4.7.11	409,286.23	92,146.08
债券利息收入		21,694.82	6,135.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		281,465.11	58,806.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-182,271,020.76	11,514,194.53
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-172,166,971.43	9,805,365.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-10,455,896.71	1,650,882.13
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	351,847.38	57,946.74
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-4,544,748.69	2,328,354.45
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	930,637.80	47,896.14
减:二.费用		8,667,750.84	2,125,550.80
1. 管理人报酬		3,348,414.42	666,245.97
2. 托管费		558,068.98	111,041.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,363,702.12	999,334.61
5. 利息支出		74,570.32	-
其中:卖出回购金融资产支出		74,570.32	-
6. 其他费用	7.4.7.20	322,995.00	348,929.20
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-193,840,436.33	11,921,982.78
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		-193,840,436.33	11,921,982.78

7.3 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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	45,151,605.19	11,517,561.62	56,669,166.81
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-193,840,436.33	-193,840,436.33
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)	60,949,801.67	275,863,203.50	336,813,005.17
其中:1.基金申购款	402,990,546.03	712,452,627.13	1,115,443,173.16
2.基金赎回款	-342,040,744.36	-436,589,423.63	-778,630,167.99
四.本期向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)	106,101,406.86	93,540,328.79	199,641,734.65
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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)	60,153,603.81	-460,835.11	59,692,768.70
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,921,982.78	11,921,982.78
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)	-15,001,998.62	56,413.95	-14,945,584.67
其中:1.基金申购款	31,013,081.54	2,722,383.50	33,735,465.04
2.基金赎回款	-46,015,080.16	-2,675,969.55	-48,691,049.71
四.本期向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)	45,151,605.19	11,517,561.62	56,669,166.81

报表附注为财务报表的不可分部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

项目	朱龙芳	顾颖
	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]193号《关于核准富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由富安达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币60,000,707.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第1196号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金合同》于2012年4月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总募集为60,153,603.81份基金份额,其中认购资金利息折合6,915.56份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、银行存款、资产支持证券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资资产配置比例为:股票投资占基金资产的比例为30-80%,债券投资占基金资产的比例为0-45%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,其余投资期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

本报告期内本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2016年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日发以后颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定以下合称"企业会计准则"、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告(标准年度报告)》、中国证券投资基金协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),基于对交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期及为此而中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所载文提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计差错更正的说明

7.4.5.1 会计差错更正

本基金于年度末日分别为1月1日起至12月31日止。

7.4.5.2 追溯重述

本基金的追溯重述不适用于本期。

7.4.6 税项

7.4.6.1 主要税种及税率

本基金本年度主要税种及税率情况如下:

税种	计税依据	税率
增值税	卖出股票、债券、基金、权证、期货合约等金融商品时产生的增值额	6%
城市维护建设税	应缴增值税	1%
教育费附加	应缴增值税	3%
地方教育附加	应缴增值税	2%

7.4.6.2 税收优惠及依据

本基金本报告期内及上年度可比期间未享受税收优惠政策。

7.4.7 金融工具

7.4.7.1 银行存款

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	11,354,083.39
等于:本金	11,354,083.39
加:应计利息	-
减:坏账准备	-
定期存款	-
等于:本金	-
加:应计利息	-
减:坏账准备	-
合计	11,354,083.39

7.4.7.2 交易性金融资产

项目	期末估值表	
	成本	公允价值
股票	169,894,186.97	149,061,756.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-
债券	-	-
资产支持证券	-	-
基金	-	-
其他	-	-
合计	169,894,186.97	149,061,756.52

7.4.7.3 衍生工具

项目	期末估值表	
	成本	公允价值
权证投资	-	-
期货投资	-	-
合计	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

项目	期末估值表	
	成本	公允价值
证券交易所市场回购	10,000,000.00	10,000,000.00
银行间同业市场回购	-	-
合计	10,000,000.00	10,000,000.00

7.4.7.5 应收利息

项目	期末估值表
应收活期存款利息	2,270.14
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,000.00
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	7,618.14
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	12,888.14

7.4.7.6 其他资产

项目	期末估值表
应收证券清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
其他	-
合计	-

7.4.7.7 其他负债

项目	期末估值表
应付证券清算款	3,521,919.40
应付赎回款	620,150.79
应付管理人报酬	280,134.46
应付托管费	43,355.72
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,612,591.95
其中:交易所市场	1,612,591.95
银行间市场	-
应付利息	-
应付利润	-
合计	6,670,489.50

7.4.7.8 实收基金

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	份额	金额
上年度末	45,151,605.19	45,151,605.19
本期申购	402,990,546.03	402,990,546.03
本期赎回(以"-"号填列)	-342,040,744.36	-342,040,744.36
本期末	106,101,406.86	106,101,406.86

7.4.7.9 未分配利润

项目	本期末 2015年12月31日
已实现部分	11,517,561.62
未实现部分	-
未分配利润	11,517,561.62

7.4.7.10 收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
股票投资差价收入	54,287,284.81	1.84%

7.4.7.11 债券投资差价收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
债券投资差价收入	-	-

7.4.7.12 债券投资利息收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
债券投资利息收入	21,694.82

7.4.7.13 买入返售证券利息收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
买入返售证券利息收入	281,465.11

7.4.7.14 其他利息收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
其他利息收入	-

7.4.7.15 股利收益

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资股利收入	351,847.38

7.4.7.16 公允价值变动收益

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资	-4,544,748.69
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生工具	-
其他	-
合计	-4,544,748.69

7.4.7.17 汇兑收益

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
汇兑收益	-

7.4.7.18 其他收入

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	930,637.80

7.4.7.19 交易费用

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	4,363,702.12
银行间市场交易费用	-
合计	4,363,702.12

7.4.7.20 其他费用

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	70,000.00
信息披露费	180,000.00
证券结算费	72,995.00
合计	322,995.00

7.4.8 报表重述说明

7.4.8.1 会计政策变更的说明

本报告期内无会计政策变更。

7.4.8.2 重大会计估计变更的说明

本报告期内无重大会计估计变更。

7.4.8.3 差错更正的说明

本报告期内无重大差错更正。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 关联方关系

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
南京证券股份有限公司(“南京证券”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司(“江苏交通”)	基金管理人的股东
南京市河西新城区国有资产经营控股(集团)有限责任公司(“南京河西”)	基金管理人的股东
富安达资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.9.2 报告期内通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.2.1 股票成交

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
南京证券	54,287,284.81	1.84%

7.4.9.2.2 债券交易本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.9.2.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.9.2.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.9.2.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	当期佣金	占当期佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	109,423.16	1.81%	-	-

注:上述佣金参考市场价格向本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除向中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.债券现金结算的服务范围还包括向金融机构收取为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,348,414.42	666,245.97
其中:支付销售机构的客户维护费	1,234,683.11	166,675.18

注1:支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构交付客户服务及销售活动产生的相关费用,该费用从基金管理人收取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。

7.4.9.2.2 基金托管费

	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	558,068.98	111,041.02

注:支付基金管理人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(回购)交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	9,999,000.00
期初持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
期间申购/买入总份额	6,365,372.37	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-