富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2013】第四季度报告

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:2014年1月21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2014年1月20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10月1日起至12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	60,153,603.81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x55%+上证国债指数收益率x45%。
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10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-574,737.10
2.本期利润	-6,301,768.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1171
4.期末基金资产净值	59,692,768.70
5.期末基金份额净值	0.9923

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	-12.70%	1.62%	-1.45%	0.62%	-11.25%	1.00%

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,

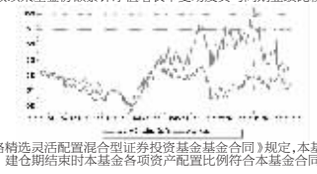
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

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: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、首席策略分析师,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。

4.3.2 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

四季度本基金基本回吐了前三个季度的努力,主要原因是10月对以创业板为首的新兴产业板块的高估值回调不够警惕,低估了新兴产业板块的回调力度与幅度,加上10月初基金净值创新高后赎回压力陡增,减仓时点等因素影响,导致净值回撤很大。在十八届三中全会后,军工、信息安全、传媒成为市场龙头,有较好的反弹,本基金也积极参与,但突如其来的IPO开闸对市场造成了较强冲击,也对本基金形成较大的杀伤力,究其原因,这与本基金以中小板和创业板为主的持仓结构相关。此外,本基金四季度过早配置了通信板块中的网优运维品种,由于其业绩和催化剂都还未能提供坚实支撑,所以导致易跌难涨,抗风险能力较弱,值得深刻总结和反省!

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本基金份额净值为0.9923元,本报告期份额净值增长率为-12.70%,同期业绩比较基准增长率为-1.45%。

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2014年,我们认为市场仍旧维持结构型行情的特点,由于2013年新兴产业涨幅巨大,估值偏贵,所以整体上市场的机会预计要小于2013年,同时2014年大量新股的发行上市虽然能给市场提供一些新的较好投资标的,但因发行市盈率预计难以较低,因此可能需要等待合适的机会。如果发行市盈率普遍较高的话,则带给市场的供给冲击压力就将比较明显,需要特别警惕。从宏观层面看,我们预计2014年仍将维持较为平淡的增长,通胀压力不是主要问题,预计全年CPI有望控制在3%以下,PPI水平仍将低位徘徊。由于欧美经济的有所复苏,虽然美国QE退出已经明确并展开,但对经济经济的负面影响暂时不大,所以2014年外需环境可能略好于2013年,但外需结构的变化也是一个不可逆转的趋势,只有跟得上结构变化的企业才有可能取得更好的成绩。相比外围金融市场的影响,我们认为2014年国内金融体系面临的去杠杆压力和地方政府债务链条压力可能对金融市场形成更大压力,尤其对债券市场的影响在2013年下半年已经深刻体现,预计至少2014年上半年这个影响不可能减弱,而且信用风险的暴露可能产生,这样的背景下,权益市场自然也不可避免的会受到一些压力和影响,需要基金管理人更加细致的挑选投资标的,应对结构性市场的特点以及系统性风险阶段性爆发的负面影响。配置上,还是会偏重于新兴产业的有关板块,去寻找在细分领域有高速增长潜力与能力的标的,去寻找有望成为细分行业龙头和真正具备科技创新和突破能力的标的,争取在2014年的基金管理中取得好成绩回报持有人!

§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	39,354,772.15	65.25
	其中:股票	39,354,772.15	65.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	4,000,126.00	6.63
	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	10,394,144.42	17.23
7	其他各项资产	6,569,361.80	10.89
8	合计	60,318,404.37	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	-	-
C	制造业	26,458,770.13	44.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,847,900.00	4.77
E	建筑业	-	-
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	8,688,902.02	14.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	29,000.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,330,200.00	2.23
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	39,354,772.15	65.93

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	300315	掌趣科技	130,000	3,728,400.00	6.25
2	600118	中国卫星	160,000	2,964,800.00	4.97
3	600372	中航电子	120,000	2,863,200.00	4.80
4	600292	中电远达	110,000	2,847,900.00	4.77
5	002465	海格通信	110,000	2,285,800.00	3.83
6	600038	哈飞股份	80,195	2,204,560.55	3.69
7	002415	海康威视	90,000	2,068,200.00	3.46
8	300020	银江股份	80,600	2,015,000.00	3.38
9	002475	立讯精密	58,849	1,966,733.58	3.29
10	300273	和佳股份	75,000	1,943,250.00	3.26

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 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.2 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

5.10.3 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	64,746.39
2	应收证券清算款	6,491,861.91
3	应收股利	-
4	应收利息	7,174.45
5	应收申购款	5,579.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,569,361.80

5.10.4 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。

5.10.5 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	52,413,031.22
本报告期基金总申购份额	33,048,144.39
减:本报告期基金总赎回份额	25,307,571.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,153,603.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	16.62

注:本报告期内,基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况,不存在利益冲突、显失公平的关联交易的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内不存在基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013/10/09 关于增加深圳众禄基金销售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通过网上交易方式办理申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告

2013/10/22 富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2013年第3季度报告

2013/12/05 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(更新)摘要

2013/12/05 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(更新)

2013/12/27 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

2013/12/31 富安达基金管理有限公司2013年12月31日基金净值公告

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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。

9.3 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
二〇一四年一月二十一日

富安达现金通货币市场证券投资基金

【2013】第四季度报告

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:2014年01月21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2014年1月20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10月1日起至12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	324,217,147.52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	25,609,192.16	298,607,955.36

§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10月01日-2013年12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	355,773.57	1,880,005.65
2.本期利润	355,773.57	1,880,005.65
3.期末基金资产净值	25,609,192.16	298,607,955.36

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

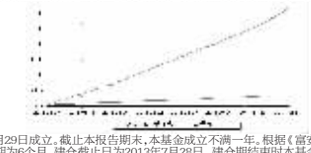
1.富安达现金通货币A

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
过去三个月	1.0467%	0.0033%	0.0883%	0.0000%	0.9584%	0.0033%

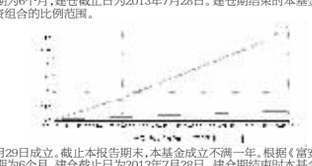
2.富安达现金通货币B

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
过去三个月	1.1079%	0.0033%	0.0883%	0.0000%	1.0196%	0.0033%

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,建仓截止日为2013年7月28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。



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,建仓截止日为2013年7月28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		
张凯瑜	本基金的基金经理、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。

4.3.2 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

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。

4.3.2 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

报告期内由于临近年末因素,资金成本居高不下,年末时点各期限资金价格更是逼近年中钱荒时的高点,债券市场也依然处于调整态势。在持仓方面,我们对债券进行了部分调仓,降低了组合久期,保持了较低仓位,并且通过资金价格的波动调整回存和回购的期限和比例,在保持流动性的前提下锁定收益。

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1.0467%,富安达现金通货币B份额净值收益率为1.1079%,同期业绩比较基准收益率为0.0883%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年初资金面有所缓解,但债市仍有压力,一方面市场成员的配置意愿不高,市场观望气氛较浓;另一方面央行持续谨慎的态度加之IPO重启等因素,预计今年流动性环境不容乐观。目前众多债券的收益率较为可观,但基础不稳,债券价格上涨空间有限。我们将继续关注利率市场和债券市场,加强对组合内各类资产的管理,合理配置基金资产。

§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	39,973,743.19	12.31
	其中:债券	39,973,743.19	12.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	19,600,149.40	6.04
	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	263,493,288.59	81.15
4	其他资产	1,615,315.83	0.50
5	合计	324,682,497.01	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	0.57	
	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的比例为报告期内每个交易日融资余额占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	34
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	68
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

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	84.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	3.08	-
2	30天(含)—60天	3.08	-
	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	12.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.65	-

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。

5.4 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	29,973,381.98	9.24
	其中:政策性金融债	29,973,381.98	9.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,000,361.21	3.08
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	39,973,743.19	12.33
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	9,994,713.33	3.08

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	041356017	13天山水泥CP002	100,000	10,000,361.21	3.08
2	120233	12国开33	100,000	9,994,713.33	3.08
3	130201	13国开01	100,000	9,993,030.89	3.08
4	130210	13国开10	100,000	9,985,637.76	3.08

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	20
报告期内偏离度的最高值	-0.0721%
报告期内偏离度的最低值	-0.3442%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2062%

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固定单位净值交易方式,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	1,498,117.11
4	应收申购款	117,198.72
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	1,615,315.83

§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
本报告期期初基金份额总额	23,543,978.51	99,943,301.71
本报告期基金总申购份额	71,695,159.52	547,542,101.41
减:本报告期基金总赎回份额	69,629,945.87	348,877,447.76
本报告期期末基金份额总额	25,609,192.16	298,607,955.36

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 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内不存在基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2013/10/09 关于增加深圳众禄基金销售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通过网上交易方式办理申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告

2013/10/22 富安达现金通货币市场证券投资基金2013年第3季度报告

2013/12/31 富安达基金管理有限公司2013年12月31日基金净值公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准富安达现金通货币市场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披露的各项公告

中国证监会要求的其他文件

9.2 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。

9.3 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
二〇一四年一月二十一日

富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:富安达基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21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2014年1月20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10月25日(产品成立日)起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达信用纯债债券发起式	
基金主代码	000284	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	99,544,133.64份	
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,积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。	
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