国投瑞银中高等级债券型证券投资基金

【2014】第三季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月24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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国投瑞银中高等级债券	
基金主代码	000069	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年5月14日	
报告期末基金份额总额	410,603,537.86份	
投资目标	主要投资于中高等级非国家信用债券,通过积极主动的投资管理,力争实现战胜业绩基准的收益。	
投资策略	本基金采取"自上而下"的债券分析方法,确定债券模拟组合,并管理组合风险。 本基金基于均衡收益率曲线进行基本价值评估,计算不同资产类别、不同剩余期限债券品种的预期超额回报,并对预期超额回报进行排序,得到投资评级。在此基础上,卖出内部收益率低于均衡收益率的债券,买入内部收益率高于均衡收益率的债券。 债券投资策略主要包括:久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略。在不同的时期,采用以上策略对组合收益和风险的贡献不尽相同,具体采用何种策略取决于债券组合允许的风险程度。	
业绩比较基准	中证信用债指数收益率×95%+中证可转换债券指数收益率×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国投瑞银中高等级债券A	国投瑞银中高等级债券C
下属两级基金的交易代码	000069	000070
报告期末下属两级基金的份额总额	309,210,388.79份	101,393,149.07份

§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

基金简称	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)	
	国投瑞银中高等级债券A	国投瑞银中高等级债券C
1.本期已实现收益	5,405,724.64	1,549,178.32
2.本期利润	8,936,561.81	2,792,144.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.0346
4.期末基金资产净值	332,536,171.00	108,941,766.66
5.期末基金份额净值	1.075	1.074

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。

2、以上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(例如基金申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

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

国投瑞银中高等级债券A

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	3.14%	0.09%	1.81%	0.05%	1.33%	0.04%

国投瑞银中高等级债券C

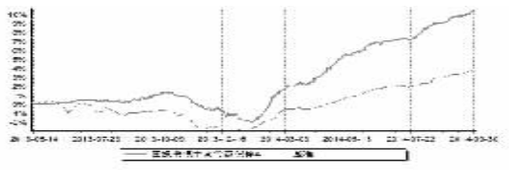
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.05%	0.08%	1.81%	0.05%	1.24%	0.03%

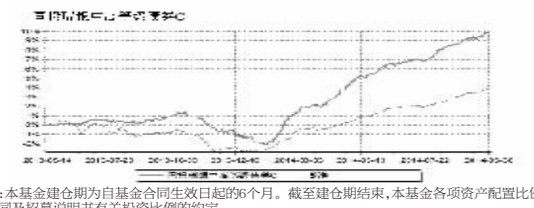
注:1、本基金为债券型基金,主要投资于中高等级非国家信用债券。根据本基金在市场中性预期下的资产配置比例,本基金选取中证信用债指数收益率×95%+中证可转换债券指数收益率×5%作为本基金的业绩比较基准。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国投瑞银中高等级债券A





注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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		
陈翔凯	本基金基金经理、固定收益部总监	2013年5月14日		17	中国籍,硕士,具有基金从业资格。2008年5月加入国投瑞银。先后任职于基金投资部、专户投资部。现任国投瑞银货币市场基金、国投瑞银双债增利债券基金、国投瑞银稳定增利债券基金、国投瑞银中高等级债券基金、国投瑞银瑞易货币市场基金基金经理。
刘兴旺	本基金基金经理	2013年5月16日		9	中国籍,硕士,具有基金从业资格。曾任职申银万国证券、华宝兴业基金、泰信基金。2012年11月加入国投瑞银。现任国投瑞银纯债债券基金、国投瑞银中高等级债券基金和国投瑞银岁添利一年期定期开放债券基金基金经理。

注: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。证券从业的含义遵从行业协会《证券业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

在报告期内,本基金管理人遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银中高等级债券型证券投资基金基金合同》等有关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉,忠实尽职的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内,基金的投资决策规范,基金运作合法合规,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。本报告期,本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债市先抑后扬,整体延续二季度的牛市走势,信用利差、基准利率继续下行,我们认为推动牛市的基础是货币政策中性宽松,经济复苏弱于预期以及流动性较为充裕所致。7月上半月受超预期的宏观金融数据以及资金面走高冲击,收益率出现一波快速上行,10年期金融债从4.9%最高上行至5.35%附近;随后在央行两度下调正回购利率并再推5000亿SLF支撑下,利率产品稳步下行,10年期金融债最低下行至接近4.7%附近。城投债整体表现略强于同期限的利率产品,利差继续缩窄。

三季度我们对长期利率产品较为谨慎,虽躲过了短暂的下跌但也没有享受到收益率下行,不过在信用债上我们加大了配置力度,一定程度上弥补了在长债上错失的机会。我们积极根据规模变化调整仓位,保持适度杠杆水平,管理好组合流动性,努力提高组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金A类份额净值为1.075元,C类份额净值为1.074元,本报告期A类份额净值增长率为3.14%,C类份额净值增长率为3.05%,同期业绩基准增长率为1.81%,基金净值增长率高于业绩基准收益率,主要是采用了比较高的杠杆,并且超配城投债。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们认为经济复苏弱于预期,定向政策仍有空间,货币市场利率较为宽松,短期收益率曲线有望维持平坦化;预计12月份后通胀压力会有所增大,届时收益率曲线有望陡峭化。因此我们将维持适中的组合久期,保持适度杠杆,以获取票息收益为主。我们认为新政后城投债内部将分化,部分将向产业债靠拢,未来的1-2年均为信用风险释放期,我们将严控信用风险,精选信用债。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	626,916,147.33	96.03
	其中:债券	626,916,147.33	96.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,224,526.96	0.65
8	其他各项资产	21,706,631.75	3.32
9	合计	652,847,306.04	100.00

5.2 报告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投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	49,810,000.00	11.28
	其中:政策性金融债	49,810,000.00	11.28
4	企业债券	346,434,532.45	78.47
5	企业短期融资券	129,446,600.00	29.32
6	中期票据	75,726,000.00	17.15
7	可转债	25,499,014.88	5.78
8	其他	-	-
9	合计	626,916,147.33	142.00

5.5 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	0980123	09晋交投债	300,000	29,625,000.00	6.71
2	041472016	14冀发展CP001	250,000	25,000,000.00	5.66
3	041459034	14云投CP002	240,000	24,129,600.00	5.47
4	122579	09远洋债	230,000	23,046,000.00	5.22
5	111041	08铁岭债	200,240	20,614,708.00	4.67

5.6 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证资产。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 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	31,829.41
2	应收证券清算款	6,543,005.46
3	应收股利	-
4	应收利息	11,514,589.33
5	应收申购款	3,617,207.55
6	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	21,706,631.75

5.11.4 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	110015	石化转债	15,303,450.80	3.47

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金本期未投资托管行股票、未投资控股股东主承销的证券,未从二级市场主动投资分离交易可转债附送的权证,投资流通受限证券未违反相关法规或本基金管理公司的规定。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	国投瑞银中高等级债券A	国投瑞银中高等级债券C
本报告期期初基金份额总额	205,312,558.77	62,392,564.81
本报告期基金总申购份额	213,361,403.39	93,401,870.08
减:本报告期基金总赎回份额	109,463,573.37	54,401,285.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	309,210,388.79	101,393,149.07

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内本基金管理人无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

1.报告期内基金管理人对本基金分红进行公告,指定媒体公告时间为2014年9月9日。

2.报告期内基金管理人对调整旗下部分基金单笔申购最低金额限制进行公告,指定媒体公告时间为2014年9月3日。

3.报告期内基金管理人对在直销渠道开通旗下基金跨TA转换业务进行公告,指定媒体公告时间为2014年8月29日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

《关于核准国投瑞银中高等级债券型证券投资基金募集的批复》(证监基金[2013]217号)

《关于国投瑞银中高等级债券型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2013]343号)

《国投瑞银中高等级债券型证券投资基金基金合同》

《国投瑞银中高等级债券型证券投资基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银中高等级债券型证券投资基金2014年第三季度报告原文

9.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

存放网址:http://www.ubssdic.com

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

咨询电话:400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司
二〇一四年十月二十七日

富安达增强收益债券型证券投资基金

【2014】第三季度报告

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10月27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10月24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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达增强收益债券	
基金主代码	710301	
交易代码	710301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年7月25日	
报告期末基金份额总额	28,775,804.25份	
投资目标	本基金将在控制风险与保持资产流动性的基础上,力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	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×90%+沪深300指数收益率×10%	
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。	
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	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属两级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属两级基金的份额总额	13,087,066.44份	15,688,737.81份

§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(2014年7月1日-2014年9月30日)	
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
1.本期已实现收益	773,171.25	870,429.97
2.本期利润	999,376.73	1,129,587.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0676	0.0656
4.期末基金资产净值	14,320,171.36	17,003,761.01
5.期末基金份额净值	1.0942	1.0838

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自《公开募集证券投资基金运作管理办法》发布之日起至本季度末,本基金净资产已连续20个工作日低于5000万。

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

富安达增强收益债券A

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	6.74%	0.35%	2.74%	0.13%	4.00%	0.22%

富安达增强收益债券C

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	6.63%	0.35%	2.74%	0.13%	3.89%	0.22%

注:①本基金业绩比较基准为:10%×沪深300指数+90%×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:

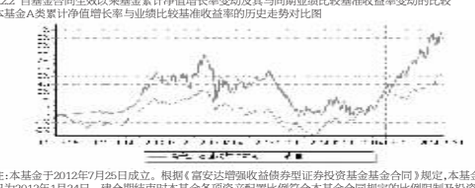
Return t =10%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+90%×[中债总财富总指数t / 中债总财富总指数(t-1) -1]

Benchmark t =(1+Return t)×Benchmark(t-1)

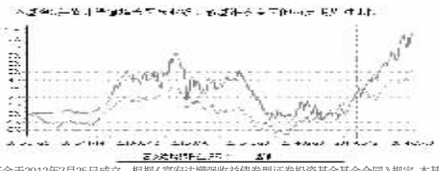
其中,t =1,2,3,…T,T 表示时间截至日。

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

本基金A类累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金于2012年7月25日成立。根据《富安达增强收益债券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2013年1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。



注:本基金于2012年7月25日成立。根据《富安达增强收益债券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2013年1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		
李飞	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	2012年7月4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

注:1、基金经理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,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、《富安达增强收益债券型证券投资基金合同》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

对政府未来改革预期的憧憬,银行间市场资金价格有回落,三季度国内资本市场出现了股债双牛领涨全球的新局面。股票整体上涨,中债总财富指数也上行了1.6%。本基金因势利导,适时加大了股票转债的投资仓位,对信用债进行结构调整,保持了中等的杠杆比例,取得了一定的投资效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,富安达增强收益债券A份额净值为1.0942元,C份额净值为1.0838元;本报告期富安达增强收益债券A份额净值增长率为6.74%,C份额净值增长率为6.63%,同期业绩比较基准增长率为2.74%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金在宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截至2014年9月30日,富安达增强收益债券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2013年1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。

§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	6,176,368.00	12.87
	其中:股票	6,176,368.00	12.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,054,612.89	79.29
	其中:债券	38,054,612.89	79.29
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	779,683.87	1.62
8	其他各项资产	2,981,378.48	6.21
9	合计	47,992,043.24	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

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	143,310.00	0.46
B	采矿业	344,000.00	1.10
C	制造业	4,904,952.00	15.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	411,138.00	1.31
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	372,968.00	1.19
S	综合	-	-
	合计	6,176,368.00	19.72

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	601965	中国汽研	68,000	945,200.00	3.02
2	600081	东风科技	37,000	521,700.00	1.67
3	002446	盛路通信	20,000	483,400.00	1.54
4	002008	大族激光	20,000	391,000.00	1.25
5	600088	中视传媒	18,400	372,968.00	1.19
6	601958	金钼股份	40,000	344,000.00	1.10
7	300128	锦富新材	21,600	342,792.00	1.09
8	002701	奥瑞金	15,000	341,850.00	1.09
9	600171	上海贝岭	30,000	341,700.00	1.09
10	000970	中科三环	20,000	324,600.00	1.04

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	1,685,874.90	5.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,106,726.80	16.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,832,000.00	63.31
7	可转债	11,430,011.19	36.49
8	其他	-	-
9	合计	38,054,612.89	121.49

5.5 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	1282490	12川国栋MTN1	100,000	10,056,000.00	32.10
2	1282487	12博源MTN1	100,000	9,776,000.00	31.21
3	128005	齐翔转债	30,040	3,532,373.56	11.28
4	110025	国金转债	17,900	2,211,187.00	7.06
5	110027	东方转债	16,220	1,949,481.80	6.22

5.6 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.2 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

5.11.3 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	26,976.40
2	应收证券清算款	1,795,464.53
3	应收股利	-
4	应收利息	1,157,838.19
5	应收申购款	1,099.36
6	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
10	合计	2,981,378.48

5.11.4 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	110020	南山转债	1,552,638.00	4.96
2	128003	华天转债	689,375.63	2.20
3	110015	石化转债	545,150.00	1.74
4	128001	泰尔转债	200,309.20	0.64

5.11.5 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

	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
本报告期期初基金份额总额	16,998,644.95	20,994,531.60
本报告期基金总申购份额	373,509.27	5,841,747.06
减:本报告期基金总赎回份额	4,285,087.78	11,147,540.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,087,066.44	15,688,737.81

§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

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

2014/07/01富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行、手机银行费率优惠活动的公告

2014/07/01富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行、手机银行费率优惠活动的公告

2014/07/18富安达优势成长股票型证券投资基金2014年第2季度报告

2014/08/28富安达优势成长股票型证券投资基金2014年半年度报告摘要

2014/08/28富安达优势成长股票型证券投资基金2014年半年度报告

2014/09/09富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一四年第二号)摘要

2014/09/09富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一四年第二号)

§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增强收益债券型证券投资基金设立的文件

《富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》

《富安达增强收益债券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
二〇一四年十月二十七日

富安达优势成长股票型证券投资基金

【2014】第三季度报告

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10月27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10月24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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达优势成长股票
基金主代码	710001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月21日
报告期末基金份额总额	175,959,267.63份
投资目标	本基金定位为股票型证券投资基金。在充分控制风险的前提下,精选具有竞争优势及持续成长性的上市公司,分享中国经济高速发展带来的收益,力争获得超越投资基准的收益。
投资策略	本基金采用自上而下的多维经济模型,通过对全球经济发展形势、国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合FED模型,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测,并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时将定性分析与定量分析贯穿于行业配置和个股选择的投资全过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于证券投资基金中预期风险和预计收益较高的基金产品。
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(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期