富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2014 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：2015年3月28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2015年3月27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2014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	45,151,605.19
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×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	刘涛	汤嵩彦
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999(免长途)021-61870666	95559
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	2014年	2013年	2012年4月25日-2012年12月31日
本期已实现收益	9,593,628.33	24,677,551.97	-22,957,256.20
本期利润	11,921,982.78	12,687,708.75	-11,396,052.02
加权平均基金份额本期利润	0.2827	0.1773	-0.0379
本期加权平均净值利润率	26.79%	16.90%	-3.89%
本期基金份额净值增长率	26.48%	4.98%	-2.01%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	11,517,561.62	-460,835.11	-17,260,677.13
期末可供分配基金份额利润	0.2551	-0.0077	-0.1024
期末基金资产净值	56,669,166.81	59,692,768.70	165,220,104.75
期末基金份额净值	1.2551	0.9923	0.9799
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	30.12%	2.87%	-2.01%

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。

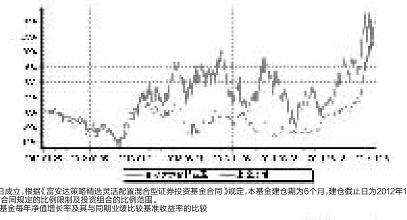
3.2 基金净值表现

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	11.25%	1.87%	23.36%	0.90%	-12.11%	0.97%
过去六个月	21.31%	1.49%	32.82%	0.73%	-11.51%	0.76%
过去一年	26.48%	1.47%	28.79%	0.67%	-2.31%	0.80%
自基金合同生效日起至今（2012年04月25日-2014年12月31日）	30.12%	1.30%	24.97%	0.70%	5.15%	0.60%

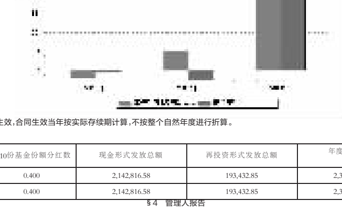
注：①本基金业绩比较基准为：55%×沪深300指数+45%×上证国债指数，
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：
Return t =55%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+45%×[上证国债指数t / 上证国债指数(t-1) -1]
Benchmark t =（1+Return t）×Benchmark(t-1)
其中，t =1,2,3,…T，T 表示时间截至日。

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：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。

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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	0.400	2,142,816.58	193,432.85	2,336,249.43	
合计	0.400	2,142,816.58	193,432.85	2,336,249.43	

§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2014年12月31日，公司共管理六只开放式基金：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、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。

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		
黄强先生	本基金的基金经理、公司研究发展部副总监	2012年4月25日	-	21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，中国国籍经济学硕士。

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、《富安达策略精选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 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

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的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

上半年管理人对市场的判断是主板市场仍旧以低位震荡区间波动为主，上涨无望，大幅下跌也不太现实；对于创业板市场的结构性行情相对看好；A股市场整体上在"存量经济、存量资金、存量市场"的格局下运行。但是，从国内经济增长态势、经济结构调整格局来看，未来两三年国内资本市场的机会应仍主要来自于战略性新兴产业，因此管理人仍将大部分基金资产配置在新兴产业板块上。一季度，管理人积极挖掘了游戏、移动互联网、智慧城市、医疗器械与服务，高端装备制造等板块的投资机会，取得较好的投资收益；但在三月份的创业板市场回调中未能及时兑现盈利，净值遭受较大回撤。自五月份以后，由于"微刺激"与"定向降准"的信号和措施越来越强，市场也基本能够告别"钱荒"在二季度末再度来袭的担忧，市场情绪有所回暖；同时，"微刺激"与"定向降准"的政策也让市场更清晰的认识到高层对于经济结构调整的决心，所以市场上行的动能迅速地再度向以TMT、医疗、新能源（汽车）、高端装备制造为代表的中小板、创业板聚集，基金管理人也积极加大操作力度，提高资金效率，挖掘个股机会，取得一定成效。上半年总体而言投资的利润捕捉尚可，但风险防范与回撤控制仍显不足。三季度市场波动较大，季度初始A股市场面临较大回调压力，宏观数据不稳定和TMT行业短期涨幅较大带来市场较大的回调压力，但在央行不断推进定向降准宽松措施的努力以及反腐工作推进得到重要成绩的刺激下，国别溢价上升，无风险利率的持续下降也带来资产定价的格局变化，债市的持续牛市一定程度上打杀了市场对金融风险的担忧，央行在资产端的持续努力改善了市场对金融市场前景的预期，而沪港通的出台在一定程度上改善了投资者对存量资金的纠结。在新能源汽车与军工板块的带领下，在增量资金和融资盘资金的推动下，A股在7月末开始有力上涨。四季度A股市场的表现可以用近年罕见来形容，市场风格强烈转换。在季度之初上证综指还在面临2400点左右的上行压力，市场还在犹豫"400点大反弹"是不是已经结束之时，低估值蓝筹的估值修复行情其实一直在缓慢进行中，只不过被成长股行情所掩盖，之后在一路一带、沪港通等几大主题的带领下，尤其在意外降息的刺激下，非银金融带领主板市场走出波澜壮阔的上涨行情，增量资金规模不断扩大，融资融券规模不断创出历史新高，券商、保险、建筑、银行、高铁等板块轮番带领低估值蓝筹股和低价大盘股上涨，带动转债市场也一路上涨，伴随着交易时代的股指期货等对冲工具，市场也在一路上涨中展开大幅震荡，市场风格强烈转换，年末小票出现大幅回吐。

回顾本基金一年的操作，有可圈可点之处，但也有不少遗憾。在成长股投资方面抓住了一些大机会但也错失不少机会，对移动互联时代的社会发展的认知仍需要进一步提高。基于对去杠杆后直接融资的发展潜力以及以新三板为标志的多层次资本市场格局的初步形成，基金管理人较早地意识到券商作为直接融资市场发展主体的重要性和发展空间，较早地配置了券商股，但基金管理人也未能像灵活的趋势交易者那样全仓半仓券商股，因此未能实现更大收益。在互联网股票和类新股估值都趋于泡沫化的2015年，需要更严谨地选择标的，着重企业基本面研究和估值的安全边际，以防陷入"伪成长"陷阱；并且随时警惕估值泡沫破灭的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日，本基金份额净值为1.2551元，本报告期份额净值增长率为26.48%，同期业绩比较基准收益率为28.79%。

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2015年，宏观经济仍面临诸多风险因素，房地产降温、债务去杠杆、外需复苏缓慢、美国加息、国际政局动荡，都亟待宽松政策对冲风险；同时抑制债务泡沫、推进人民币国际化等目标又抑制宽松力度。预计央行除了维持2014 年以来的货币政策框架，继续使用MLF、SLF、PSL 等货币政策工具以定向的方式提供社会信用并维持短期流动性价格稳定外，经济将进入新一轮降息降准周期，引导社会融资成本下行，对冲外部高利率下降的冲击。物价水平持续走低，流动性中性偏松的预期意味着社会无风险利率依然具有下行空间。预计2015年总需求仍将继续萎缩，投资下滑，消费走弱，出口亦存在诸多不确定性，需求曲线或将左移；但改革政策的持续、油价下跌，有利于改善经常项目顺差，并推动供给曲线右移，使得各年经济增速取得在相对平稳的水平。大宗商品价格下降对经济的利好将逐步兑现，油价下跌将会利于中国总生产成本下降，直接促进经济增长，但通缩风险也需关注。总体来看，预计2015 年中国经济依然能够维持增速，通胀压力不大，政府将维持积极的财政政策和中性偏松的货币政策，经济结构转型和改革政策推进是中国宏观经济层面的主要亮点。

市场方面，经济转型仍是投资主线。随着中国经济进入新常态，表现为产业投资转向基础设施投资、新兴产业投资和服务业投资，出口增长转向推动企业对外投资，经济结构转型已经逐渐明朗化，战略性新兴产业和服务业是政策支持的重点；经济转型的方向将围绕互联网、医疗健康服务、高端装备制造和军工、新能源环保等领域展开。过去互联网的出现改变了人们的消费行为和生活习惯，未来互联网将越来越多地服务于生产，以平台化为基础，聚合企业、生态链和金融机构，提供信息和服务。由于劳动年龄人口趋于减少，老龄人口快速增多，人口抚养比的提升意味着我国居民的消费结构将表现为生活性消费比重提升，生产性消费比重下降，经济增长结构中第三产业的比重会不断提升，医疗、保健、养老等各种服务型消费需求将显著增加。从资金面来看，无风险利率下行及流动性中性偏松的预期，居民不断增加的资产重新配置需求，也将给资本市场带来正面的动力，有利于成长股的估值维持在较高的水平。总体我们认为2015年的市场机遇风险并存，基金管理人将一如既往在控制风险的前提下力争把握市场的结构性机会，努力为基金持有人获取超额收益。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期末进行收益分配。

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

2014年度，基金托管人在富安达策略精选灵活配置混合型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

2014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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本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

2014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2014年12月31日的资产负债表、2014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。注册会计师单峰、沈兆杰于?2015?年?3?月?27?日签字出具了普华永道中天审字(2015)第20758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：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,359,100.30	946,222.57
结算备付金		3,118,325.40	9,447,921.85
存出保证金		64,354.69	64,746.39
交易性金融资产	7.4.7.2	53,874,816.45	39,354,772.15
其中：股票投资		45,397,916.45	39,354,772.15
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	-	4,000,126.00
应收证券清算款		-	6,491,861.91
应收利息	7.4.7.5	9,725.00	7,174.45
应收股利		-	-
应收申购款		33,800.52	5,579.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		58,460,122.36	60,318,404.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013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		871,132.87	-
应付赎回款		131,101.90	102,823.12
应付管理人报酬		69,138.86	73,904.42
应付托管费		11,523.14	12,317.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	197,840.60	176,203.20
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	510,218.18	260,387.52
负债合计		1,790,955.55	625,635.67
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	45,151,605.19	60,153,603.81
未分配利润	7.4.7.10	11,517,561.62	-460,835.11
所有者权益合计		56,669,166.81	59,692,768.70
负债和所有者权益总计		58,460,122.36	60,318,404.37

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.2551元，基金份额总额45,151,605.19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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		14,047,533.58	15,811,103.27
1.利息收入		157,088.46	685,093.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	92,146.08	101,538.82
债券利息收入		6,135.80	541,576.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		58,806.58	41,978.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		11,514,194.53	26,864,686.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	9,805,365.66	26,468,329.65
基金投资收益			
债券投资收益	7.4.7.13	1,650,882.13	67,263.29
7.4.7.14	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	57,946.74	329,093.59
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	7.4.7.17	2,328,354.45	-11,989,843.22
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	47,896.14	251,166.37
减：二、费用		2,125,550.80	3,123,394.52
1.管理人报酬		666,245.97	1,141,093.12
2.托管费		111,041.02	190,182.17
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	999,334.61	1,394,521.43
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	348,929.20	397,597.80
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		11,921,982.78	12,687,708.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		11,921,982.78	12,687,708.75

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：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 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	2,732,383.50	33,745,465.04
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
项 目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	168,612,550.24	-3,392,445.49	165,220,104.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,687,708.75	12,687,708.75
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)	-108,458,946.43	-7,419,848.94	-115,878,795.37
其中：1.基金申购款	89,182,702.04	5,251,895.51	94,434,597.55
2.基金赎回款	-197,641,648.47	-12,671,744.45	-210,313,392.92
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)	-	-2,336,249.43	-2,336,249.43
五、期末所有者权益（基金净值）	60,153,603.81	-460,835.11	59,692,768.70

报表附注为财务报表的组成部分。

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 主管会计工作负责人	顾颖 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]第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的净认购资金为583,296,937.09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118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额为583,363,852.64份基金份额，其中认购资金利息折合66,915.55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。

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（包含中小板、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）。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0-65%，权证投资占基金资产净值的比例为0-3%，现金及到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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其它的产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准是：沪深300指数收益率×55%＋上证国债指数收益率×45%。

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日颁布的《企业会计准则－基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会于2010年2月8日发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《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》及中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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2014年12月31日的财务状况以及2014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。本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1.以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

2.基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

3.对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。其中，对基金从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额。

4.基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
活期存款	1,359,100.30	946,222.57
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计	1,359,100.30	946,222.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		44,081,628.71	45,397,916.45	1,316,287.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	7,893,472.33	8,476,900.00	583,427.67
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,893,472.33	8,476,900.00	583,427.67
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		51,975,101.04	53,874,816.45	1,899,715.41
项目		上年度末 2013年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		39,783,411.19	39,354,772.15	-428,639.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		39,783,411.19	39,354,772.15	-428,639.04

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

项目	上年度末 2013年12月31日	
合计	-	-
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	4,000,126.00	-
合计	4,000,126.00	-

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	200.04	1,670.28
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	1,716.31	2,792.37
应收债券利息	7,779.62	-
应收买入返售证券利息	-	2,682.60
应收申购款利息	0.03	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	29.00	29.20
合计	9,725.00	7,174.45

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
交易所市场应付交易费用	197,353.11	174,569.01
银行间市场应付交易费用	487.49	1,634.19
合计	197,840.60	176,203.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	218.18	387.52
预提费用	510,000.00	260,000.00
合计	510,218.18	260,387.52

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	60,153,603.81	60,153,603.81
本期申购	31,013,081.54	31,013,081.54
本期赎回(以"-"号填列)	-46,015,080.16	-46,015,080.16
本期末	45,151,605.19	45,151,605.19

注：1.申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,338,334.22	-8,799,169.33	-460,835.11
本期利润	9,593,628.33	2,328,354.45	11,921,982.78
本期基金份额交易产生的变动数	-1,046,545.92	1,102,959.87	56,413.95
其中：基金申购款	6,288,389.35	-3,556,005.85	2,732,383.50
基金赎回款	-7,334,935.27	4,658,965.72	-2,675,969.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,885,416.63	-5,367,855.01	11,517,561.62

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
活期存款利息收入	36,186.34	30,298.30
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	55,000.51	69,728.03
其他	959.23	1,512.49
合计	92,146.08	101,538.82

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
卖出股票成交总额	330,692,120.94	491,028,256.86
减：卖出股票成本总额	320,886,755.28	464,559,927.21
买卖股票差价收入	9,805,365.66	26,468,329.65

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,650,882.13	67,263.29
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,650,882.13	67,263.29

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	26,953,325.38	39,420,539.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	25,272,341.46	38,354,788.45
减：应收利息总额	30,101.79	998,488.20
买卖债券差价收入	1,650,882.13	67,263.29

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度未获得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度未获得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未获得衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	57,946.74	329,093.59
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	57,946.74	329,093.59

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
1.交易性金融资产	2,328,354.45	-11,989,843.22
——股票投资	1,744,926.78	-11,955,467.33
——债券投资	583,427.67	-34,375.89
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	2,328,354.45	-11,989,843.22

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
基金赎回费收入	46,804.81	241,412.58
基金转换费收入	1,091.33	1,013.10
其他收入	-	8,740.69
合计	47,896.14	251,166.37

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
交易所市场交易费用	999,334.61	1,394,321.43
银行间市场交易费用	-	200.00
合计	999,334.61	1,394,521.43

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	250,000.00	300,000.00
汇划手续费	2,529.20	1,197.80
帐户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	400.00	400.00
合计	348,929.20	397,597.80

7.4.8 关联方关系

7.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，关联方关系未发生变化。

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本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	666,245.97	1,141,093.12
其中：支付销售机构的客户维护费	166,675.18	402,348.83

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约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，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

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	111,041.02	190,182.17

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0.25%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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	-	-
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	9,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	22.15%	16.62%

7.4.9.4.2 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：份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		上年度末 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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
富安达资产管理(上海)有限公司	12,405,848.47	27.48%		-

7.4.9.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,359,100.30	36,186.34	946,222.57	30,298.30

注：1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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"交通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2014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。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10 期末（2014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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额
002331	皖通科技	2014-11-10	重大事项	15.62	2015-03-25	14.09	65,000	1,013,909.00	1,015,300.00
002396	星网锐捷	2014-10-20	重大事项	27.31	2015-02-09	30.04	37,600	1,129,667.83	1,026,856.00
300081	恒信移动	2014-12-05	重大事项	25.45	2015-03-05	28.00	35,000	810,595.00	890,750.00
300168	万达信息	2014-12-31	重大事项	46.20	2015-01-08	44.50	60,100	2,245,920.35	2,776,620.00
300252	金信诺	2014-11-11	重大事项	43.40	2015-01-28	46.99	10,000	324,163.08	434,000.00

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。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	45,397,916.45	77.66
	其中：股票	45,397,916.45	77.66
2	固定收益投资	8,476,900.00	14.50
	其中：债券	8,476,900.00	14.50
	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	-	-
	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	4,477,425.70	7.66
7	其他各项资产	107,880.21	0.18
8	合计	58,460,122.36	100.00

8.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,192,000.00	2.10
C	制造业	12,472,795.78	22.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,894,010.00	6.87
F	批发和零售业	2,663,750.00	4.70
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	11,527,797.87	20.34
J	金融业	10,209,450.00	18.02
K	房地产业	3,430,700.00	6.05
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	-	-
S	综合	7,412.80	0.01
	合计	45,397,916.45	80.11

8.3 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	300253	卫宁软件	55,000	3,848,350.00	6.79
2	000024	招商地产	130,000	3,430,700.00	6.05
3	600068	葛洲坝	300,000	2,799,000.00	4.94
4	300168	万达信息	60,100	2,776,620.00	4.90
5	600316	洪都航空	90,000	2,517,300.00	4.44
6	601318	中国平安	29,000	2,166,590.00	3.82
7	600655	豫园商城	150,000	1,773,000.00	3.13
8	600155	宝硕股份	140,000	1,668,800.00	2.94
9	000776	广发证券	64,000	1,660,800.00	2.93
10	600990	四创电子	28,000	1,623,440.00	2.86

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富安达基金管理有限公司网站的年度报告正文。

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300253	卫宁软件	8,304,029.39	13.91
2	600316	洪都航空	7,515,905.00	12.59
3	601318	中国平安	5,631,931.12	9.43
4	300017	网宿科技	4,730,209.40	7.92
5	300170	汉得信息	4,448,230.26	7.45
6	000801	四川九洲	4,170,591.00	6.99
7	300168	万达信息	4,168,240.50	6.98
8	300024	机器人	4,090,359.55	6.85
9	002475	立讯精密	3,772,370.31	6.32
10	300043	互动娱乐	3,770,889.76	6.32
11	600212	江泉实业	3,541,926.66	5.93
12	300352	北信源	3,541,918.06	5.93
13	002366	丹甫股份	3,400,621.74	5.70
14	300084	海默科技	3,364,875.90	5.64
15	600699	均胜电子	3,259,746.47	5.46
16	002219	恒康医疗	3,256,382.42	5.46
17	300131	英唐智控	3,231,621.00	5.41
18	000024	招商地产	3,087,445.08	5.17
19	300059	东方财富	2,997,429.00	5.02
20	601788	光大证券	2,962,691.00	4.96
21	600120	浙江东方	2,936,495.01	4.92
22	600068	葛洲坝	2,888,689.93	4.84
23	300273	和佳股份	2,810,728.41	4.71
24	002635	安洁科技	2,748,470.64	4.60
25	600366	宁波韵升	2,686,750.00	4.50
26	601377	兴业证券	2,645,550.00	4.43
27	002396	星网锐捷	2,620,843.00	4.39
28	002416	爱施德	2,604,036.00	4.36
29	600315	上海家化	2,573,690.00	4.31
30	600990	四创电子	2,559,359.00	4.29
31	600887	伊利股份	2,558,359.00	4.29
32	002583	海能达	2,479,546.00	4.15
33	002555	顺荣股份	2,471,075.00	4.14
34	002353	杰瑞股份	2,448,551.36	4.10
35	600655	豫园商城	2,447,615.00	4.10
36	300075	数字政通	2,386,421.00	4.00
37	300397	天和防务	2,335,384.00	3.91
38	002148	北纬通信	2,301,824.70	3.86
39	300177	中海达	2,279,809.07	3.82
40	002405	四维图新	2,243,504.55	3.76
41	300298	三诺生物	2,199,586.11	3.68
42	002191	劲嘉股份	2,194,313.25	3.68
43	002230	科大讯飞	2,166,528.00	3.63
44	002195	海隆软件	2,158,712.00	3.62
45	002390	信邦制药	2,134,277.15	3.58
46	002401	中海科技	2,100,347.00	3.52
47	600643	爱建股份	2,075,896.00	3.48
48	300110	华仁药业	2,054,700.00	3.44
49	300173	松德股份	2,038,742.00	3.42
50	300065	海兰信	2,009,108.00	3.37
51	300287	飞利信	2,003,547.00	3.36
52	300020	银江股份	1,973,391.10	3.31
53	002312	三泰电子	1,881,834.90	3.15
54	002491	通鼎光电	1,879,475.99	3.15
55	000001	平安银行	1,867,200.00	3.13
56	300182	捷成股份	1,865,322.51	3.12
57	002414	高德红外	1,844,656.00	3.09
58	002292	奥飞动漫	1,844,527.94	3.09
59	600750	江中药业	1,842,991.81	3.09
60	002049	同方国芯	1,822,247.00	3.05
61	002223	鱼跃医疗	1,821,420.00	3.05
62	600150	中国船舶	1,809,998.00	3.03
63	000970	中科三环	1,766,050.00	2.96
64	000776	广发证券	1,757,220.46	2.94
65	002642	荣之联	1,747,908.20	2.93
66	000988	华工科技	1,721,760.00	2.88
67	300369	绿盟科技	1,715,719.94	2.87
68	300251	光线传媒	1,708,934.20	2.86
69	600155	宝硕股份	1,694,753.00	2.84
70	600588	用友软件	1,679,020.00	2.81
71	000425	徐工机械	1,668,348.00	2.79
72	300378	鼎捷软件	1,653,811.70	2.77
73	002174	游族网络	1,641,014.20	2.75
74	002373	千方科技	1,591,558.00	2.67
75	300188	美亚柏科	1,545,620.50	2.59
76	002331	皖通科技	1,543,279.00	2.59
77	603456	九洲药业	1,499,769.00	2.51
78	002527	新时达	1,492,432.00	2.50
79	000039	中集集团	1,487,185.37	2.49
80	300248	新开普	1,473,488.00	2.47
81	300339	润和软件	1,466,399.00	2.46
82	002614	蒙发利	1,446,235.20	2.42
83	600038	中直股份	1,438,925.00	2.41
84	600079	人福医药	1,432,219.00	2.40
85	300183	东软载波	1,403,622.00	2.35
86	600522	中天科技	1,399,715.88	2.34
87	002660	茂硕电源	1,399,082.50	2.34
88	300124	汇川技术	1,389,865.67	2.33
89	600446	金证股份	1,386,866.00	2.32
90	600587	新华医疗	1,382,100.00	2.32
91	600057	象屿股份	1,376,830.00	2.31
92	300178	腾邦国际	1,353,953.32	2.27
93	600217	秦岭水泥	1,350,506.50	2.26
94	002559	亚威股份	1,335,258.00	2.24
95	300333	兆日科技	1,314,263.00	2.20
96	002426	胜利精密	1,308,057.00	2.19
97	600650	锦江投资	1,303,627.00	2.18
98	002410	广联达	1,301,395.00	2.18
99	300347	泰格医药	1,297,568.50	2.17
100	002030	达安基因	1,284,788.22	2.15
101	600566	洪城股份	1,276,282.90	2.14
102	002502	骅威股份	1,263,047.00	2.12
103	002569	步森股份	1,262,770.00	2.12
104	300245	天玑科技	1,258,575.05	2.11
105	300380	安硕信息	1,251,961.00	2.10
106	600999	招商证券	1,249,812.00	2.09
107	000541	佛山照明	1,249,095.99	2.09
108	300113	顺网科技	1,245,505.95	2.09
109	600030	中信证券	1,243,500.00	2.08
110	600395	盘江股份	1,241,772.76	2.08
111	600525	长园集团	1,236,214.20	2.07
112	002318	久立特材	1,226,751.00	2.06

注：1、"买入金额"按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300024	机器人	6,347,306.00	10.63
2	002475	立讯精密	6,018,460.04	10.08
3	300253	卫宁软件	5,215,761.00	8.74
4	300273	和佳股份	5,143,035.81	8.62
5	300017	网宿科技	4,930,508.50	8.26
6	600316	洪都航空	4,669,202.00	7.82
7	300170	汉得信息	4,669,012.22	7.82
8	601788	光大证券	4,416,800.00	7.40
9	300020	银江股份	4,269,218.32	7.15
10	300315	掌趣科技	4,009,233.00	6.72
11	600887	伊利股份	3,962,156.82	6.64
12	601318	中国平安	3,876,621.80	6.49
13	300084	海默科技	3,748,284.18	6.28
14	600212	江泉实业	3,573,680.00	5.99
15	300043	互动娱乐	3,443,630.00	5.77
16	600372	中航电子	3,286,987.80	5.51
17	002465	海格通信	3,247,865.97	5.44
18	600699	均胜电子	3,240,196.70	5.43
19	600038	中直股份	3,231,509.50	5.41
20	300131	英唐智控	3,186,910.00	5.34
21	000801	四川九洲	3,112,163.00	5.21
22	600120	浙江东方	3,079,787.00	5.16
23	600118	中国卫星	3,003,416.40	5.03
24	300168	万达信息	2,990,925.00	5.01
25	300059	东方财富	2,939,079.00	4.92
26	002219	恒康医疗	2,782,040.00	4.66
27	600366	宁波韵升	2,732,370.00	4.58
28	002415	海康威视	2,717,420.30	4.55
29	002292	奥飞动漫	2,708,239.59	4.54
30	300183	东软载波	2,617,692.35	4.39
31	600292	中电远达	2,600,859.00	4.36
32	002635	安洁科技	2,566,317.65	4.30
33	600315	上海家化	2,537,978.62	4.25
34	300177	中海达	2,535,588.19	4.25
35	002583	海能达	2,510,804.86	4.21
36	002555	顺荣股份	2,499,081.00	4.19
37	600150	中国船舶	2,494,614.61	4.18
38	002353	杰瑞股份	2,478,931.32	4.15
39	002405	四维图新	2,451,613.76	4.11
40	601377	兴业证券	2,421,639.61	4.06
41	300188	美亚柏科	2,407,169.00	4.03
42	300075	数字政通	2,375,274.89	3.98
43	002191	劲嘉股份	2,371,847.81	3.97
44	002195	海隆软件	2,360,334.04	3.95
45	002416	爱施德	2,356,166.99	3.95
46	002148	北纬通信	2,337,581.84	3.92
47	002230	科大讯飞	2,280,100.00	3.82
48	600643	爱建股份	2,242,800.00	3.76
49	002390	信邦制药	2,236,893.00	3.75
50	300397	天和防务	2,192,591.00	3.67
51	002366	丹甫股份	2,144,408.56	3.59
52	300110	华仁药业	2,092,935.00	3.51
53	002373	千方科技	2,087,585.00	3.50
54	600588	用友软件	2,076,250.00	3.48
55	300352	北信源	2,067,064.45	3.46
56	300113	顺网科技	2,046,722.98	3.43
57	300065	海兰信	2,012,460.74	3.37
58	300173	松德股份	2,000,611.30	3.35
59	002401	中海科技	1,988,821.81	3.33
60	002223	鱼跃医疗	1,936,578.07	3.24
61	300251	光线传媒	1,918,249.36	3.21
62	002491	通鼎光电	1,917,781.30	3.21
63	002642	荣之联	1,897,927.80	3.18
64	000001	平安银行	1,887,000.00	3.16
65	300287	飞利信	1,886,162.00	3.16
66	300155	安居宝	1,876,595.00	3.14
67	002049	同方国芯	1,874,960.00	3.14
68	300182	捷成股份	1,865,777.08	3.13
69	600750	江中药业	1,865,670.00	3.13
70	000970	中科三环	1,842,252.77	3.09
71	000988	华工科技	1,794,000.00	3.01
72	300380	安硕信息	1,780,500.50	2.98
73	300248	新开普	1,759,407.00	2.95
74	300298	三诺生物	1,756,157.25	2.94
75	002294	信立泰	1,750,874.00	2.93
76	002414	高德红外	1,710,490.00	2.87
77	002312	三泰电子	1,706,307.52	2.86
78	002174	游族网络	1,694,175.02	2.84
79	600650	锦江投资	1,650,607.15	2.77
80	300339	润和软件	1,549,335.99	2.60
81	000039	中集集团	1,530,189.84	2.56
82	002660	茂硕电源	1,502,081.00	2.52
83	600079	人福医药	1,501,050.00	2.51
84	300369	绿盟科技	1,479,916.80	2.48
85	600566	洪城股份	1,449,213.40	2.43
86	600217	秦岭水泥	1,432,456.00	2.40
87	600446	金证股份	1,430,900.00	2.40
88	002396	星网锐捷	1,418,523.00	2.38
89	600587	新华医疗	1,411,520.00	2.36
90	600057	象屿股份	1,382,925.00	2.32
91	603456	九洲药业	1,378,840.00	2.31
92	002426	胜利精密	1,377,186.00	2.31
93	300347	泰格医药	1,337,700.00	2.24
94	300124	汇川技术	1,336,789.49	2.24
95	002614	蒙发利	1,334,427.80	2.24
96	002318	久立特材	1,321,400.00	2.21
97	002126	银轮股份	1,293,250.00	2.17
98	600522	中天科技	1,292,492.99	2.17
99	002653	海思科	1,267,560.00	2.12
100	000750	国海证券	1,264,250.00	2.12
101	002559	亚威股份	1,263,095.00	2.12
102	002573	国电清新	1,258,800.00	2.11
103	300299	富春通信	1,253,926.65	2.10
104	002138	顺络电子	1,240,446.99	2.08
105	600525	长园集团	1,229,788.80	2.06
106	002410	广联达	1,208,532.19	2.02
107	002030	达安基因	1,204,175.00	2.02
108	300379	东方通	1,195,356.00	2.00

注：1、"卖出金额"按买出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

买入股票的成本(成交)总额	325,184,972.80
卖出股票的收入(成交)总额	330,692,120.94

注："买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	-	-
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	8,476,900.00	14.96
8	其他	-	-
9	合计	8,476,900.00	14.96

8.6 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	113501	洛钼转债	24,000	3,045,600.00	5.37
2	113005	平安转债	15,000	2,706,300.00	4.78
3	110029	浙能转债	11,000	1,539,560.00	2.72
4	113001	中行转债	4,000	626,360.00	1.11
5	110023	民生转债	4,000	553,080.00	0.98

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.9 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。

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，基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内除宝硕股份(600155)外，没有受到公开谴责、处罚。

宝硕股份(600155)于2014年8月1日发布公告称，因涉嫌虚假陈述2006年被立案调查一事，已由中国证券监督管理委员会（以下简称"证监会"）调查完毕，公司接到证监会2014年7月1日下发的［2014]69号《行政处罚决定书》。公司原大股东宝硕集团已经破产，受处罚人员均已离职。公司经历资产重组后，大股东和主业都已经变更，目前公司大股东为新希望化工投资有限公司。

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下，公司进行了审慎研究评估，整个过程中严格履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	64,354.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,725.00
5	应收申购款	33,800.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,880.21

8.12.4 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	113005	平安转债	2,706,300.00	4.78
2	113001	中行转债	626,360.00	1.11
3	110023	民生转债	553,080.00	0.98

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300168	万达信息	2,776,620.00	4.90	重大事项

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

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
615	73,417.24	31,096,871.07	68.87%	14,054,734.12	31.13%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	29,761.60	0.07%

注：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 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年4月25日)基金份额总额	583,363,852.64
本报告期期初基金份额总额	60,153,603.81
本报告期基金总申购份额	31,013,081.54
减：本报告期基金总赎回份额	46,015,080.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,151,605.19

§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：

根据《公司法》和《富安达基金管理有限公司章程》的规定，富安达基金管理有限公司于2014年4月3日在公司召开职工大会，经与会职工民主投票，同意孔学兵同志为富安达基金管理有限公司第二届职工董事。

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，聘任秦雁同志为公司董事会董事长（法定代表人）。本基金管理人已于2014年4月17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[2014]412号文核准批复。

经富安达基金管理有限公司第二届董事会第一次会议审议通过，同意督察长陈宁同志因已届法定退休年龄辞去督察长职务，提名张丽珉同志为公司督察长。本基金管理人已于2015年3月4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高级管理人变更的公告。督察长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[2015]297号文核准批复。

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稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人本报告期内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	
光大证券	1	14,355,243.20	2.20%	13,068.87	2.20%	
广发证券	1	53,464,743.06	8.20%	48,674.52	8.20%	
国金证券	2	113,726,524.30	17.43%	103,536.52	17.43%	
国泰君安	1	113,053,661.31	17.33%	102,924.35	17.33%	
海通证券	1	9,123,781.30	1.40%	8,306.27	1.40%	
华泰证券	1	58,350,799.52	8.94%	53,122.61	8.94%	
兴业证券	1	97,589,661.36	14.96%	88,845.52	14.96%	
招商证券	2	192,671,278.57	29.54%	175,407.73	29.54%	
申银万国	2		-	-	-	
南京证券	2		-	-	-	
中信证券	2		-	-	-	
银河证券	1		-	-	-	
东方证券	2		-	-	-	
中金公司	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本报告期没有新增的券商交易单元。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
光大证券	-	-	500,000.00	0.72%	-	-
广发证券	2,928,620.60	5.16%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	50,727,241.90	89.44%	39,400,000.00	56.37%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,062,000.00	5.40%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	30,000,000.00	42.92%	-	-
申银万国		-		-		-
南京证券		-		-		-
中信证券		-		-		-
银河证券		-		-		-
东方证券		-		-		-
中金公司		-		-		-

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本报告期没有新增的券商交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

富安达基金管理有限公司
二〇一五年三月二十八日