富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第一季度报告

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:2015年4月20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2015年4月16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2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达新兴成长混合
基金主代码	000755
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月11日
报告期末基金份额总额	1,340,056,340.13份
投资目标	本基金通过股票与债券等资产的合理配置,通过深入研究并积极投资于新兴产业及其相关行业中的高速成长企业,分享新兴产业发展所带来的投资机会,在有效控制风险的前提下,力争为投资者带来长期的超额收益。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型,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。同时结合富安达择时量化模型,辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。一般情况下,本基金将大部分基金资产投资于新兴产业及其相关行业中成长型上市公司所发行的股票等证券,当证券市场系统性风险加大时,本基金将降低相关证券资产的配置比例。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,一般情况,其风险和预期收益低于股票型基金,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(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	11,437,105.00
2.本期利润	32,884,662.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.1368
4.期末基金资产净值	1,706,529,751.76
5.期末基金份额净值	1.2735

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	34.19%	2.06%	20.26%	0.89%	13.93%	1.17%

注:①本基金业绩比较基准为:60%×中证新兴产业指数+40%×中债总指数,

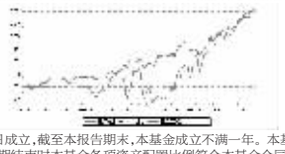
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =60%×[中证新兴产业指数t / 中证新兴产业指数(t-1)-1]+40%×[中债总指数t / 中债总指数(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



注:本基金于2014年9月11日成立,截至本报告期末,本基金成立不满一年。本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2015年3月10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		
孔学兵	本基金的基金经理、富安达优势成长股票型证券投资基金基金经理、公司投资管理部总监、富安达基金管理有限公司董事	2014年9月11日	-	19年	历任南京证券股份有限公司证券投资总部投资经理;资产管理总部投资主办、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

2014年以来,尽管宏观经济层面依然乏善可陈,但受益于经济结构调整的不断推进、改革红利的不断释放以及货币政策的持续宽松,投资者信心大幅回升,中国资本市场活力迸发,市场指数屡创近年新高,市场已经彻底激活。

一季度,经济改革举措仍陆续提出,既有传统产业的去杠杆(降低国家资产负债率,以资本市场的股权融资消化与取代债务融资)、优化与输出产能(如"一带一路"战略)、推动所有制改革(典型代表是国企改革与以多层次资本市场加大民间资本投资),又有新兴产业"大众创新、万众创业"号角的吹响。市场以指数的稳健上行,表达了对政治改革与经济转型的热烈期望,表达了对一系列根本性的经济改革大略的认同与支持。

随着IPO制度稳定与发行逐步加力,新股赚钱效应明显,从新股发行到二级市场交易良性衔接,充分展现市场的本质是有效活跃的投融资对接。一季度,IPO发行68支,明显的赚钱效应在激活一级市场热情的同时,也大力地为二级市场输送新活力,其中不乏代表着整个经济转型潮流的优质标的;这些优质新股的涓涓细流终将汇聚为二级市场活力与投资的新浪潮。IPO新股投资已然开启另一种新价值投资大幕。

一季度本基金遭遇大比例申购,考虑到成长股一季度涨幅较大,面临回调压力,后续策略上将逐步转向稳健型成长,侧重对新兴产业的长期价值成长及优质新股投资,实现基金净值稳健长期增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年3月31日,本基金份额净值为1.2735元,本报告期份额净值增长率为34.19%,同期业绩比较基准增长率为20.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

低增长背景下经济波幅收敛,无风险利率下行引发的风险偏好提升成为驱动市场的主导力量。"一路一带"的走出去和"国企改革"的内部优化,有助于市场对中国经济的预期从硬着陆转变为软着陆,在此背景下,经济增长的短期波动以及行业景气度等业绩因素都会被淡化,在居民资产配置调整浪潮推动下,传统周期蓝筹的估值修复仍有一定空间,而新兴成长领域受益于经济结构调整与社会变迁进程,更将进发出巨大的活力。只要上述逻辑不被破坏,市场中长期乐观是可以期待的。

经新一届政府的改革举措,各方面正在逐步接受中国经济的新常态,即经济增速放缓、经济增长方式转变、经济结构调整。市场层面,经济新常态的确立缓解了投资人对经济增长的悲观预期,使宏观经济、金融结构和股票市场回归到正常的发展节奏。具体来看:一方面,对经济的稳定预期会使传统行业估值得到修复;另一方面受益于改革和经济结构调整,以互联网+等为代表的新经济将会成为市场的持续热点。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	74,708,199.17	4.37
	其中:股票	74,708,199.17	4.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,633,626,359.00	95.61
8	其他资产	361,075.56	0.02
9	合计	1,708,695,633.73	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

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	-	-
C	制造业	8,734,292.00	0.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,547,550.00	0.44
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	50,602,357.17	2.97
J	金融业	7,824,000.00	0.46
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	74,708,199.17	4.38

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002439	启明星辰	420,000	18,274,200.00	1.07
2	601318	中国平安	100,000	7,824,000.00	0.46
3	600674	川投能源	335,000	7,547,550.00	0.44
4	300168	万达信息	88,000	7,208,960.00	0.42
5	300059	东方财富	140,000	5,824,000.00	0.34
6	600571	信雅达	97,000	5,429,090.00	0.32
7	002491	通鼎互联	200,000	4,770,000.00	0.28
8	300392	腾信股份	30,000	4,652,700.00	0.27
9	002153	石基信息	38,000	4,632,200.00	0.27
10	000547	闽福发A	116,000	2,611,160.00	0.15

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序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。

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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	150,811.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	138,675.63
5	应收申购款	71,587.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	361,075.56

5.11.4 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。

5.11.5 报告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	7,208,960.00	0.42	重大事项
2	300059	东方财富	5,824,000.00	0.34	重大事项
3	002491	通鼎互联	4,770,000.00	0.28	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	104,679,160.39
报告期期间基金总申购份额	1,331,174,337.39
减:报告期期间基金总赎回份额	95,797,157.65
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,340,056,340.13

§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

2015/01/01富安达基金管理有限公司2014年12月31日基金净值公告

2015/01/21关于增加上海联泰资产管理有限公司等为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

2015/01/21富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2014年第4季度报告

2015/01/28富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与北京增财基金销售有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告

2015/01/28富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与上海联泰资产管理有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告

2015/03/28富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2014年年度报告

2015/03/28富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2014年年度报告(摘要)

§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新兴成长灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

《富安达新兴成长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
二〇一五年四月二十日

富安达现金通货币市场证券投资基金

【2015】第一季度报告

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:2015年04月20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2015年4月16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2015年1月1日起至3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	112,955,924.23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	
下属分级基金的基金简称	富安达现金通货币A	富安达现金通货币B
下属分级基金的交易代码	710501	710502
报告期末下属分级基金的份额总额	39,199,719.79份	73,756,204.44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(2015年01月01日-2015年03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	408,954.90	1,534,188.42
2.本期利润	408,954.90	1,534,188.42
3.期末基金资产净值	39,199,719.79	73,756,204.44

注: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。

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	1.0646%	0.0118%	0.0863%	0.0000%	0.9783%	0.0118%

2、富安达现金通货币B

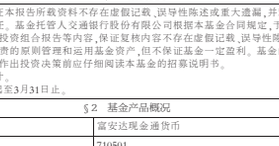
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1242%	0.0118%	0.0863%	0.0000%	1.0379%	0.0118%

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

富安达现金通货币A

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年01月29日-2015年03月31日)



注:本基金于2013年1月29日成立。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。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	-	7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

报告期内债券市场呈现过山车行情,年初债券市场温和起步,资金面宽松,债券收益率缓慢下行,其中利率债领涨信用债紧随其后。二月份由于春节因素,资金面较为紧张,今年春节后没有重现往年年后资金回流银行带来的流动性充裕,债券市场以一级市场利率上行为标志,进入调整步伐。节后央行降息兑现并下调回购利率,释放价格信号,但此次降息效果较弱,市场热情明显降温,机构多选择获利兑现。报告期内规模波动较大,我们主要根据规模变动情况和市场调整情况对债券资产和同存资产进行了动态调整。

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1.0646%,富安达现金通货币B份额净值收益率为1.1242%,同期业绩比较基准收益率为0.0863%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

节后IPO发行节奏加快、股票市场火爆、债券供给加大、人民币汇率形成机制的变化等因素均不利于短期流动性。ST湘鄂佛违约加大信用风险,我们认为今年在稳增长宽信用的格局下,信用风险是收敛的,但个别事件仍会对市场造成有限的冲击。一季度颁布的《存款保险条例》将于5月1日起正式实施,从隐性全额保险转向显性限额保险,有利于降低金融市场系统性风险。存款保险费率的上缴,长期来看可能会提升银行负债端的成本,短期来看相当于一次性缴准,可能对银行间流动性带来扰动,但此前两次降息央行已经逐步放开存款端利率浮动上限,因此预计扰动幅度有限。下一阶段我们将严格控制久期,注意防范民营企业违约风险,坚持中高等级短久期策略,获取短端滚动供给压力上升下的超额收益。

§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	80,138,923.36	70.62
	其中:债券	80,138,923.36	70.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	30,740,901.45	27.09
4	其他资产	2,602,933.46	2.29
5	合计	113,482,758.27	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	2.74
	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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	121
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

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	0.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	26.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	26.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	26.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	17.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.17	-

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	9,982,674.32	8.84
	其中:政策性金融债	9,982,674.32	8.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	70,156,249.04	62.11
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	80,138,923.36	70.95
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	041460052	14津华能CP001	100,000	10,038,633.67	8.89
2	041461041	14潍坊滨投CP001	100,000	10,033,794.91	8.88
3	041473007	14天富CP001	100,000	10,028,189.59	8.88
4	041560006	15昌源水务CP001	100,000	10,017,530.24	8.87
5	041463010	14海南交投CP001	100,000	10,014,797.37	8.87
6	041452024	14国电南自CP001	100,000	10,012,060.29	8.86
7	041460106	14海控投资CP002	100,000	10,011,242.97	8.86
8	120229	12国开29	100,000	9,982,674.32	8.84

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2483%
报告期内偏离度的最低值	0.1013%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1777%

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 其他资产构成

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	2,298,860.92
4	应收申购款	304,072.54
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,602,933.46

§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
报告期期初基金份额总额	22,205,727.88	134,254,249.59
报告期基金总申购份额	122,453,916.01	204,651,669.57
减:报告期基金总赎回份额	105,459,924.10	265,149,714.72
报告期期末基金份额总额	39,199,719.79	73,756,204.44

注: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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2015年01月12日	2,000,000.00	-2,000,000.00	-
2	申购	2015年02月04日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
3	基金转换(出)	2015年02月09日	10,000,000.00	-10,000,000.00	-
4	赎回	2015年02月12日	2,000,000.00	-2,000,000.00	-
5	赎回	2015年03月09日	2,000,000.00	-2,000,000.00	-
6	赎回	2015年03月16日	2,000,000.00	-2,000,000.00	-
合计			28,000,000.00	28,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2015/01/01富安达基金管理有限公司2014年12月31日基金净值公告

2015/01/21关于增加上海联泰资产管理有限公司等为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

2015/01/21富安达现金通货币市场证券投资基金2014年第4季度报告

2015/02/12富安达现金通货币市场证券投资基金2015年春节前两个工作日暂停申购(含定投及转换转入)业务的公告

2015/03/14富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一五年第一号)摘要

2015/03/14富安达现金通货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一五年第一号)

2015/03/28富安达现金通货币市场证券投资基金2014年年度报告

2015/03/28富安达现金通货币市场证券投资基金2014年年度报告(摘要)

§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
二〇一五年四月二十日

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第一季度报告

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