富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:2015年07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。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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4月1日起至6月30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	
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	18,236,497.26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。本基金将基于对微观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,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	富安达信用主题A	富安达信用主题C
下属两级基金的交易代码	000284	000285
报告期末下属两级基金的份额总额	15,251,102.19份	2,985,395.07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

主要财务指标	报告期(2015年04月01日-2015年06月30日)	
	富安达信用主题A	富安达信用主题C
1.本期已实现收益	566,179.88	324,232.53
2.本期利润	849,785.52	325,074.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0608	0.0700
4.期末基金资产净值	22,454,716.89	4,361,677.55
5.期末基金份额净值	1.4723	1.4610

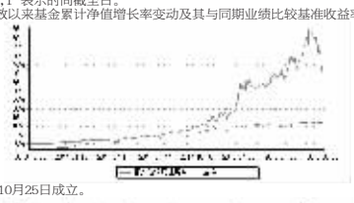
注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
③本基金于2013年10月25日成立。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
富安达信用主题A

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	6.89%	1.70%	2.27%	0.13%	4.62%	1.57%

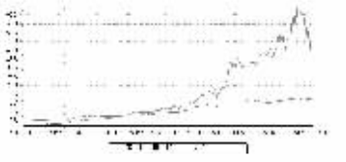
富安达信用主题C

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	6.79%	1.70%	2.27%	0.13%	4.52%	1.57%

注:①本基金业绩比较基准为: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 =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



注:本基金于2013年10月25日成立。



§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、富安达增强收益债券型证券投资基金基金经理、公司固定收益部副总监(支持工作)	2013年10月25日		12年	历任上海技术应用技术学院财政经济系教师;紫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
张凯瑜	本基金的基金经理、富安达现金通货市市场证券投资基金基金经理	2013年10月25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、《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金合同》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
二季度股市巨幅波动,6月份后融资强平去杠杆造成市场大跌,多数股票抹去了前期的涨幅并陷入流动性挤兑漩涡。债市表现相对平稳,经济增长和通胀数据依旧利好债市,但一级市场供给压力加大造成债券收益率曲线继续陡峭化变动。本基金前期受益于权益性转债配置,但对6月降杠杆下跌行情预期不足,造成显著回撤。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2015年6月30日,富安达信用纯债债券发起式A份额净值为1.4723元,C份额净值为1.4610元;富安达信用纯债债券发起式A份额净值增长率为6.89%,C份额净值增长率为6.79%,同期业绩比较基准增长率为2.27%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金为发起式基金,基金运作未满三年,不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定。
4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
股市下跌造成居民财富效应的消失,抵累内需对经济的提振作用,进一步缓解通胀压力,同时投资者风险偏好的降低也吸资金投向债市。股市血雨腥风大跌之后将显著分化,部分个股已经出现很好的投资价值。基于此,我们将提升债券投资比例,提升久期,同时精选优质转债进行投资。

§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	32,138,747.60	88.56
	其中:债券	32,138,747.60	88.56
	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	2,116,216.59	5.83
8	其他资产	2,033,871.48	5.60
9	合计	36,288,835.67	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
本基金本报告期未未持有股票。
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
本基金本报告期未未持有股票。
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	1,841,445.60	6.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,031,148.40	70.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,266,153.60	42.01
8	其他	-	-
9	合计	32,138,747.60	119.85

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	112141	12金王债	100,000	9,980,000.00	37.22
2	128009	歌尔转债	18,200	2,889,796.00	10.78
3	126018	08江铜债	29,360	2,888,143.20	10.77
4	113501	洛钼转债	19,350	2,698,164.00	10.06
5	113007	吉视转债	17,000	2,106,130.00	7.85

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
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 本基金本报告期期末未持有股票。
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	8,373.25
2	应收证券清算款	722,516.08
3	应收股利	-
4	应收利息	539,035.53
5	应收申购款	763,946.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,033,871.48

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	128009	歌尔转债	2,889,796.00	10.78
2	113501	洛钼转债	2,698,164.00	10.06
3	113007	吉视转债	2,106,130.00	7.85

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

报告期期初基金份额总额	373,122,267.37
报告期期间基金总申购份额	2,557,384,875.51
减:报告期期间基金总赎回份额	1,777,205,367.60
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	1,153,301,775.28

§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	16,439,042.99
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	16,439,042.99
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.43

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
2015-04-20富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金2015年第1季度报告
2015-05-08富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一五年第一号)
2015-08富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(二〇一五年第一号)
2015-06-10富安达基金管理有限公司关于开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告
2015-06-12关于增加上海汇付金融服务有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告
2015-06-16富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与上海汇付金融服务有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告
2015-06-26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
§10 备查文件目录
10.1 备查文件目录
中国证监会批准富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金设立的文件
《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》
《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金合同》
《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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
10.2 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。
10.3 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
二〇一五年七月二十一日

富安达优势成长股票型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7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2015年7月17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4月1日起至6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	1,153,301,775.28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

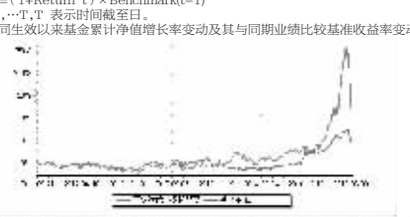
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	-105,744,756.33
2.本期利润	-659,698,339.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.8074
4.期末基金资产净值	2,752,116,635.57
5.期末基金份额净值	2.3863

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	26.92%	3.91%	8.44%	1.96%	18.48%	1.95%

注:①本基金业绩比较基准为:75%×沪深300指数+25%×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 =75%×[沪深300指数t / 沪深300指数(t-1)-1]+25%×[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《富安达优势成长股票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2012年3月20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、富安达新兴成长灵活配置混合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	2011年9月21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、《富安达优势成长股票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
二季度股市巨幅波动,6月份后融资强平去杠杆造成市场大跌,多数股票抹去了前期的涨幅并陷入流动性挤兑漩涡。债市表现相对平稳,经济增长和通胀数据依旧利好债市,但一级市场供给压力加大造成债券收益率曲线继续陡峭化变动。本基金前期受益于权益类资产和转债配置,但对6月降杠杆下跌行情预期不足,造成显著回撤。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2015年6月30日,富安达增强收益债券A份额净值为1.5267元,C份额净值为1.5080元;本报告期富安达增强收益债券A份额净值增长率为12.36%,C份额净值增长率为12.26%,同期业绩比较基准增长率为3.25%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本基金自2015年4月8日至2015年5月20日共计连续30个交易日基金净值低于5000万。自2015年5月21日起基金净值回升到5000万以上。
4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
股市下跌造成居民财富效应的消失,抵累内需对经济的提振作用,进一步缓解通胀压力,同时投资者风险偏好的降低也吸资金投向债市。股市血雨腥风大跌之后将显著分化,部分个股已经出现很好的投资价值。基于此,我们将提升债券投资比例,同时精选优质个股进行投资。

§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	2,693,384,736.70	81.31
	其中:股票	2,693,384,736.70	81.31
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	148,300,476.54	4.48
8	其他资产	470,953,592.64	14.22
9	合计	3,312,638,805.88	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

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	862,623,351.98	31.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,164,100.00	0.55
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	1,561,290,553.18	56.73
J	金融业	-	-
K	房地产业	42,701,639.00	1.55
L	租赁和商务服务业	5,100,127.14	0.19
M	科学研究和技术服务业	51,895,000.00	1.89
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	113,195,552.60	4.11
R	文化、体育和娱乐业	41,414,412.80	1.50
S	综合	-	-
	合计	2,693,384,736.70	97.87

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	600571	信雅达	2,233,939	236,462,443.15	8.59
2	300168	万达信息	4,770,000	234,302,400.00	8.51
3	002439	启明星辰	5,880,000	201,684,000.00	7.33
4	002153	石基信息	1,091,969	141,945,050.31	5.16
5	300059	东方财富	2,190,000	138,167,100.00	5.02
6	000555	神州信息	1,690,000	126,412,000.00	4.59
7	300130	新国都	3,120,000	120,151,200.00	4.37
8	300010	立思辰	3,560,000	101,531,200.00	3.69
9	300018	中元华电	2,100,000	94,920,000.00	3.45
10	300347	泰格医药	2,272,105	77,524,222.60	2.82

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	1,089,179.55
2	应收证券清算款	463,546,309.55
3	应收股利	-
4	应收利息	55,690.99
5	应收申购款	6,262,412.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	470,953,592.64

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
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

报告期期初基金份额总额	373,122,267.37
报告期期间基金总申购份额	2,557,384,875.51
减:报告期期间基金总赎回份额	1,777,205,367.60
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	1,153,301,775.28

§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	16,439,042.99
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	16,439,042.99
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.43

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
2015-04-20富安达优势成长股票型证券投资基金2015年第1季度报告
2015-05-04富安达优势成长股票型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一五年第一号)
2015-05-04富安达优势成长股票型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一五年第一号)摘要
2015-05-27富安达优势成长股票型证券投资基金暂停大额申购(含定投及转换入)业务的公告
2015-06-10富安达基金管理有限公司关于开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告
2015-06-12关于富安达基金旗下部分基金开通国泰君安证券基金费率优惠业务的公告
2015-06-12关于增加上海汇付金融服务有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告
2015-06-16富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与上海汇付金融服务有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告
2015-06-26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
§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优势成长股票型证券投资基金设立的文件
《富安达优势成长股票型证券投资基金招募说明书》
《富安达优势成长股票型证券投资基金合同》
《富安达优势成长股票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
二〇一五年七月二十一日

富安达增强收益债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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07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2015年7月17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4月1日起至6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	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年07月25日	
报告期末基金份额总额	43,322,415.01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	16,020,006.82份	27,302,408.19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04月01日-2015年06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	3,419,107.09	6,545,184.16
2.本期利润	-11,201.96	734,282.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0009	0.0308
4.期末基金资产净值	24,457,647.06	41,171,003.49
5.期末基金份额净值	1.5267	1.5080

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
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	12.36%	2.74%	3.25%	0.29%	9.11%	2.45%

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 |
|---|---|---|---