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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月26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10月23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7月1日起至2015年9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	16,303,563.67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
下属分级基金的基金简称	富安达信用主题A / 富安达信用主题C
下属分级基金的交易代码	000284 / 000285
报告期末下属分级基金的份额总额	13,619,609.22份 / 2,683,954.45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07月01日-2015年09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	-2,231,781.86	-393,472.24
2.本期利润	-2,148,643.62	-439,765.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1500	-0.1656
4.期末基金资产净值	17,939,306.73	3,504,554.43
5.期末基金份额净值	1.3172	1.3057

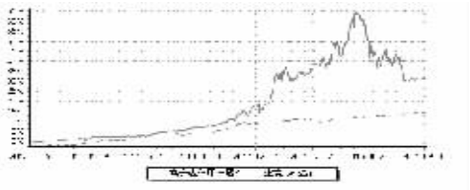
注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
③本基金于2013年10月25日成立。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
富安达信用主题A

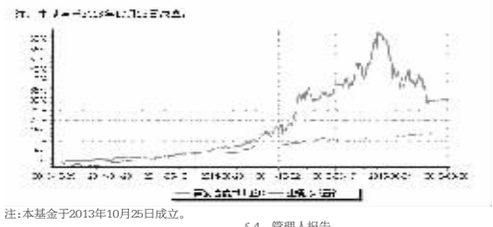
主要财务指标	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

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	-10.63%	1.26%	2.13%	0.08%	-12.76%	1.18%

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(主持工作)	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;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
张凯瑜	本基金的基金经理、富安达现金通货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 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、《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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
2015年三季度在中国资本市场上是令人难忘的三个月。始于6月的股市调整一致延续到9月末才告一段落,期间叠加一系列国内经济超预期减速、人民币意外贬值、美联储加息预期、场外配资监管升级等因素造成市场出现了超预期非理性下跌。债券市场则在风险偏好提升、资金配置需求和基本面的支撑下上涨。报告期内,本基金提升了债券仓位和久期,但受累于权益市场的下跌,净值出现了较大幅度回撤。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2015年9月30日,富安达信用纯债债券发起式A份额净值为1.3172元,C份额净值为1.3057元;富安达信用纯债债券发起式A份额净值增长率为-10.53%,C份额净值增长率为-10.63%,同期业绩比较基准增长率为0.08%。
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,截止9月30日规模低于5000万。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
泥沙俱下的大幅杀跌使得一批股票长期投资价值显现,虽然国内宏观经济还未企稳,年末存在盈利下修风险。但随着配资清理整顿完毕,股市降式下跌的概率不大。转债作为低风险投资者博取收益的工具,未来或将得益于股票市场的企稳。纯债虽然短期风险不大,但目前收益率对于长期配置资金缺乏一定安全边际。本基金将加强风险管理能力,控制净值短期回撤,适时调整资产配置,提高基金的收益。

§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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,291,970.20	89.45
	其中:债券	25,291,970.20	89.45
	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	1,360,787.43	4.81
8	其他资产	1,623,697.91	5.74
9	合计	28,276,455.54	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
本基金本报告期末未持有股票。
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
本基金本报告期末未持有股票。
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	1,258,355.80	5.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	17,378,259.00	81.04
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,655,355.40	31.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,291,970.20	117.95

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	10,146,000.00	47.31
2	110031	航信转债	15,880	2,026,764.40	9.45
3	126018	08江铜债	20,000	1,968,200.00	9.18
4	113008	电气转债	14,500	1,901,675.00	8.87
5	112130	12华包债	18,020	1,838,220.20	8.57

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
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	11,304.87
2	应收证券清算款	442,976.33
3	应收股利	-
4	应收利息	714,868.36
5	应收申购款	454,548.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,623,697.91

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	113008	电气转债	1,901,675.00	8.87
2	110030	格力转债	520,600.00	2.43
3	128009	歌尔转债	517,120.00	2.41

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

	富安达信用主题A	富安达信用主题C
报告期期初基金份额总额	15,251,102.19	2,985,395.07
报告期期间基金总申购份额	6,662,774.80	2,809,194.46
减:报告期期间基金总赎回份额	8,294,267.77	3,110,635.08
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	13,619,609.22	2,683,954.45

注:本基金于2013年10月25日成立。

§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,基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金的运作合规,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的情况。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,000.00	40.76%	9,999,000.00	40.76%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	9,999,000.00	40.76%	9,999,000.00	40.76%	

§9 影响投资者决策的其他重要信息
2015-07-01富安达基金管理有限公司2015年6月30日基金净值公告
2015-07-06富安达基金关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告
2015-07-21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2季度报告
2015-08-06富安达基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告
2015-08-22富安达基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告
2015-08-27富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金2015年半年度报告(摘要)
2015-08-27富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金2015年半年度报告
2015-09-01富安达基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告
2015-09-07关于增加申万宏源西部证券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
2015-09-18富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-23富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加利得基金为代销机构及开通定投并参与其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
二〇一五年十月二十六日

富安达增强收益债券型证券投资基金

【2015】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:2015年10月26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10月23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7月1日起至2015年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	
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	39,156,204.07份	
投资目标	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	
下属分级基金的基金简称	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属分级基金的份额总额	12,082,614.14份	27,073,589.93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07月01日-2015年09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	-4,449,094.00	-13,473,488.93
2.本期利润	-2,666,683.40	-6,567,176.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2859	-0.2450
4.期末基金资产净值	15,632,273.91	34,554,679.71
5.期末基金份额净值	1.2938	1.2763

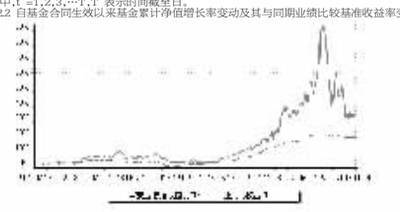
注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
富安达增强收益债券A

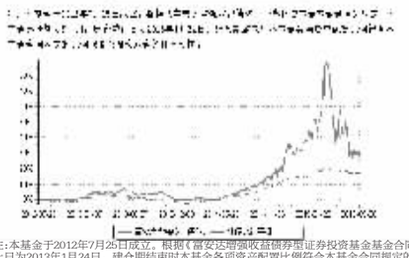
主要财务指标	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

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	-15.36%	2.00%	-1.11%	0.35%	-14.25%	1.65%

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





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、公司固定收益部副总监(主持工作)	2013年07月04日		12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、《富安达增强收益债券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
2015年三季度在中国资本市场上是令人难忘的三个月。始于6月的股市调整一致延续到9月末才告一段落,期间叠加一系列国内经济超预期减速、人民币意外贬值、美联储加息预期、场外配资监管升级等因素造成市场出现了超预期非理性下跌。债券市场则在风险偏好提升、资金配置需求和基本面的支撑下上涨。报告期内,本基金提升了债券仓位和久期,但受累于权益市场的下跌,净值出现了较大幅度回撤。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2015年9月30日,富安达增强收益债券A份额净值为1.2938元,C份额净值为1.2763元;本报告期富安达增强收益债券A份额净值增长率为-15.26%,C份额净值增长率为-15.36%,同期业绩比较基准增长率为-1.11%。
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
泥沙俱下的大幅杀跌使得一批股票长期投资价值显现,虽然国内宏观经济还未企稳,年末存在盈利下修风险。但随着配资清理整顿完毕,股市投降式下跌的概率不大。债券虽然短期风险不大,但目前收益率对于长期配置资金缺乏一定安全边际。本基金将加强风险管理能力,控制净值短期回撤,适时调整资产配置,提高基金的收益。

§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	权益投资	8,696,924.00	13.74
	其中:股票	8,696,924.00	13.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	47,901,747.47	75.70
	其中:债券	47,901,747.47	75.70
	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	3,194,286.52	5.05
8	其他资产	3,483,995.67	5.51
9	合计	63,276,953.66	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

序号	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	7,076,428.00	14.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	471,844.00	0.94
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	474,660.00	0.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	673,992.00	1.34
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	8,696,924.00	17.33

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	002367	康力电梯	75,400	1,024,686.00	2.04
2	002635	安洁科技	52,300	1,006,775.00	2.01
3	600651	飞乐音响	97,000	966,120.00	1.93
4	300306	远方光电	66,600	952,380.00	1.90
5	002580	圣阳股份	58,900	734,483.00	1.46
6	600748	上实发展	66,600	673,992.00	1.34
7	300370	安控科技	37,800	497,070.00	0.99
8	300352	北信源	16,200	474,660.00	0.95
9	002062	宏润建设	65,900	471,844.00	0.94
10	002396	星网锐捷	26,800	431,480.00	0.86

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	2,733,499.60	5.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	22,454,132.31	44.74
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,056,000.00	20.04
7	可转债	12,658,115.56	25.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	47,901,747.47	95.45

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	126018	08江铜债	112,110	11,032,745.10	21.98
2	1282487	12博源MTN1	100,000	10,056,000.00	20.04
3	113008	电气转债	37,820	4,960,093.00	9.88
4	128009	歌尔转债	36,177	4,676,962.56	9.32
5	122874	10红投01	34,180	3,521,565.40	7.02

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
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	81,124.78
2	应收证券清算款	2,478,901.67
3	应收股利	-
4	应收利息	907,649.43
5	应收申购款	16,319.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,483,995.67

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	113008	电气转债	4,960,093.00	9.88
2	128009	歌尔转债	4,676,962.56	9.32

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
报告期期初基金份额总额	16,020,006.82	27,302,408.19
报告期期间基金总申购份额	7,214,302.08	9,618,575.05
减:报告期期间基金总赎回份额	11,151,694.76	9,847,393.31
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	12,082,614.14	27,073,589.93

§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,基金管理人未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又易明细
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
2015-07-01富安达基金管理有限公司2015年6月30日基金净值公告
2015-07-06富安达基金关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告
2015-07-21富安达增强收益债券型证券投资基金2015年第2季度报告
2015-08-06 富安达基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告
2015-08-22富安达基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告
2015-08-27富安达增强收益债券型证券投资基金2015年半年度报告(摘要)
2015-08-27富安达增强收益债券型证券投资基金2015年半年度报告
2015-09-01富安达基金管理有限公司关于参加江苏银行基金定投申购费率优惠推广活动的公告
2015-09-01富安达基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告
2015-09-07关于增加申万宏源西部证券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
2015-09-18富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告
2015-09-23富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加利得基金为代销机构及开通定投并参与其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
二〇一五年十月二十六日

富安达优势成长混合型证券投资基金

【2015】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:2016年10月26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10月23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