富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金

【2017】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:2017年4月22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2017年4月21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2017年1月01日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	101,100,053.25份
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	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,通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,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。
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。
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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	3,548,589.18
2.本期利润	9,402,880.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0917
4.期末基金资产净值	208,675,743.28
5.期末基金份额净值	2.064

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

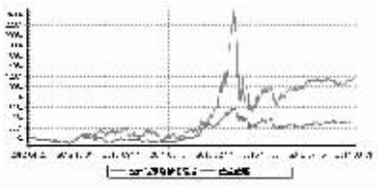
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.64%	0.53%	2.53%	0.29%	2.11%	0.24%

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。

阶段	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

富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年4月25日-2017年3月31日)



注:根据《富安达策略精选灵活配置混合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。

§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		
毛矛	本基金的基金经理	2015年5月12日	-	13年	硕士。历任中华资源(香港)有限公司交易员;易唯思商务咨询有限公司投资分析师;光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2012年4月加入富安达基金管理有限公司任高级行业研究员兼基金经理助理。2015年5月起任富安达策略精选灵活配置混合型基金、富安达健康人生灵活配置混合型基金的基金经理(2015年11月25日至2016年12月17日期间),富安达新动力灵活配置混合型基金的基金经理。

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》、《公开募集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》。

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

回顾2017年一季度,市场仍然延续了2016年结构性分化的表现,上证指数在一季度小幅上涨3.83%,部分行业上涨幅度超过10%,也有部分行业下跌。策略精选在一季度的收益为4.64%,表现超越了主要指数以及比较基准。资产配置方面,策略精选在1月上半月市场下跌过程中增加了权益类的配置,同时也调整了权益类配置的结构;在此后的上涨过程中兑现了部分收益,将权益类仓位降低到市场平均水平左右。固定收益类配置方面基本保持不变。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2017年3月31日,本基金份额净值为2.0641元,本报告期份额净值增长率为4.64%,同期业绩比较基准增长率为2.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§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	146,038,469.24	69.07
	其中:股票	146,038,469.24	69.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,433,868.70	14.39
	其中:债券	30,433,868.70	14.39
	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	10,000,000.00	4.73
	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	21,126,013.10	9.99
8	其他资产	3,833,036.68	1.81
9	合计	211,431,387.72	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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,479,325.46	4.06
B	采矿业	2,010,249.06	0.96
C	制造业	82,038,869.42	39.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,069,997.00	0.99
E	建筑业	3,299,994.98	1.58
F	批发和零售业	11,920,261.12	5.71
G	交通运输、仓储和邮政业	2,899,066.00	1.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	27,821,856.00	13.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,890,001.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,608,849.20	1.73
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	146,038,469.24	69.98

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	601318	中国平安	280,800	10,392,408.00	4.98
2	601601	中国太保	254,700	6,983,874.00	3.35
3	600584	长电科技	353,830	6,680,310.40	3.20
4	002299	圣农发展	307,894	5,723,749.46	2.74
5	000651	格力电器	158,100	5,011,770.00	2.40
6	600521	华海药业	214,617	4,721,574.00	2.26
7	601398	工商银行	900,000	4,356,000.00	2.09
8	600036	招商银行	219,700	4,211,649.00	2.02
9	002202	金风科技	262,189	4,210,755.34	2.02
10	600664	哈药股份	536,905	4,085,847.05	1.96

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,957,000.00	4.77
	其中:政策性金融债	9,957,000.00	4.77
4	企业债券	9,472,868.70	4.54
5	企业短期融资券	10,004,000.00	4.79
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,000,000.00	0.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,433,868.70	14.58

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	071721003	17渤海证券CP003	100,000	10,004,000.00	4.79
2	170301	17进出01	100,000	9,957,000.00	4.77
3	112155	12正邦债	94,890	9,472,868.70	4.54
4	113011	光大转债	10,000	1,000,000.00	0.48

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
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。
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,基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内除哈药股份(600664)外,没有受到公开谴责、处罚。
哈药集团股份有限公司(以下简称"哈药股份"),于2016年11月17日发布《哈药股份关于分公司产品抽检不合格情况的进展公告》:公司于近期接到食品药品监督管理部门出具《行政处罚决定书》,主要内容为:该企业生产的女士高盖牌钙片经检验不符合食品安全标准,违反了《黑龙江省食品安全条例》相关规定,给予哈药六厂下政处罚:1.没收违法所得105362.6元;2.处以罚款185500.8元;3.没收不合格的女士高盖牌钙片17269盒;合计罚没款196037.06元。目前,在监管部门的监督指导下,哈药六厂已修订完善了女士高盖牌钙片企业标准。
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,经公司审慎研究评估,将该股票纳入投资库进行投资。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。
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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	104,650.23
2	应收证券清算款	3,560,946.51
3	应收股利	-
4	应收利息	108,983.55
5	应收申购款	58,456.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,833,036.68

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002299	圣农发展	5,723,749.46	2.74	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	103,173,778.81
报告期期间基金总申购份额	1,618,979.36
减:报告期期间基金总赎回份额	3,692,704.92
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	101,100,053.25

§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	16,479,158.15
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	16,479,158.15
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	16.30

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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
1.2017年1月3日,富安达基金管理有限公司2016年12月31日基金净值公告
2.2017年1月16日,富安达基金管理有限公司关于副总经理离任的公告
3.2017年1月20日,富安达基金管理有限公司关于副总经理离任的公告
4.2017年1月20日,富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告
4.2017年2月23日,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手机银行申购及定期定额投资手续费率优惠的公告
5.2017年3月1日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告
6.2017年3月1日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告
7.2017年3月15日,富安达基金管理有限公司关于副总经理任职的公告
8.2017年3月15日,富安达基金管理有限公司关于副总经理离任的公告
9.2017年3月23日,富安达基金管理有限公司关于副总经理任职的公告
10.2017年3月27日,富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金参加和讯网(杭州)基金销售有限公司费率优惠活动的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1.中国证监会批准富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件:
《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
《富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
2.《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
3.基金管理人业务资格批件和营业执照;
4.基金托管人业务资格批件和营业执照;
5.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;
6.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
二〇一七年四月二十二日

富安达现金通货币市场证券投资基金

【2017】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:2017年04月22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2017年4月21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2017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	399,833,358.44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	本基金是货币市场基金,属于具有低风险收益特征的基金品种,其长期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金、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	148,162,026.95份	251,671,331.49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(2017年01月01日-2017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	700,188.47	2,150,263.32
2.本期利润	700,188.47	2,150,263.32
3.期末基金资产净值	148,162,026.95	251,671,331.49

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

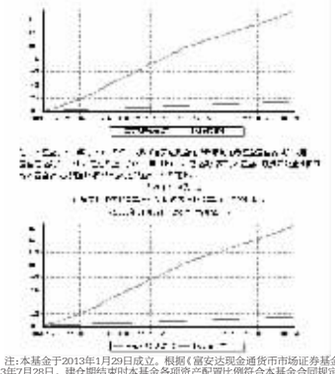
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8781%	0.0089%	0.0863%	0.0000%	0.7918%	0.0089%

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	0.9374%	0.0089%	0.0863%	0.0000%	0.8511%	0.0089%

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
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年01月29日-2017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。

§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	2013年01月29日	-	9年	硕士。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,2011年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年起任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基金经理(2013年10月25日至2016年10月25日期间)、富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理。

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》、《公开募集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》。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

截止报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按照特定计算周期,分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异,未发现公平交易异常情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内宏观经济呈现"稳中有忧"的特征,一方面,经济数据表现出"稳"的特征,工业增加值、固定资产投资、社会消费品零售总额、进出口等经济数据均呈现出"稳"的特征,但是,"稳"的背后,经济内生动力仍然不足,"忧"的特征表现为:一方面,"稳"的背后,是"忧"的特征,"稳"的背后,是"忧"的特征,"稳"的背后,是"忧"的特征