富安达长盈保本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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。基金托管人上海浦东发展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01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达长盈保本混合
基金主代码	002584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月11日
报告期末基金份额总额	231,129,070.87份
投资目标	通过运用投资组合保险技术,有效控制本金损失的风险,在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金运用CPPI恒定比例组合保险策略,动态调整安全资产与风险资产在基金组合中的投资比例,以确保保本周期到期时,基金资产在保本基础上实现保值增值的目的。
业绩比较基准	二年期银行定期存款收益率(税后)
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机 构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

§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

基金简称	报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	1,383,669.16
2.本期利润	1,312,332.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0055
4.期末基金资产净值	229,221,365.12
5.期末基金份额净值	0.992

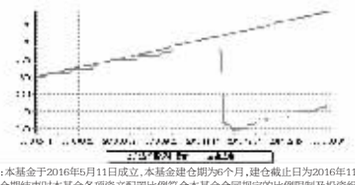
注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
③本基金于2016年5月11日成立。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.61%	0.04%	0.52%	0.01%	0.09%	0.03%

注:①本基金业绩比较基准为:二年期银行定期存款收益率
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 =今日指数t / 昨日指数(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

富安达长盈保本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
(2016年5月11日-2017年3月31日)



注:本基金于2016年5月11日成立,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2016年11月10日。截止本报告期末,本基金成立不满一年。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、投资管理部总监助理(主持工作)、公司固定收益部副总监(主持工作)	2016年5月11日	-	13年	硕士。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2012年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年7月起任富安达增强收益债券型证券投资基金、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)。
张凯瑜	本基金的基金经理	2016年7月22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)。

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、《富安达长盈保本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》。
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。
4.3.2 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震荡行情,临近季末MPA考核时点,银行普遍减少拆借导致非银机构资金也十分紧张,货币市场利率中枢大幅上行,线上和线下资金价格节节攀升,资金面陡然趋紧。报告期内数据显示经济基本面企稳向好,央行连续暂停公开市场操作,季末MPA考核资金供给承压等因素压制债市表现。在金融防风险、抑泡沫的背景下,预计央行将继续维持中性偏紧的货币政策。后续来看,随着季末因素以及MPA影响过去,我们认为短期内资金压力将明显缓解,但预计央行货币政策紧平衡态度依然坚定,我们仍要防范短期资金面冲击。当前债券利率水平具有一定配置价值,静待交易性机会来临。报告期内鉴于市场情况,我们整体以谨慎为主,投资组合暂未配置风险资产,我们对债券持仓进行了部分调仓,并根据市场情况对其他资产进行了动态调整。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2017年03月31日,本报告期富安达长盈保本混合份额净值为0.992元,净值增长率为0.61%,同期业绩比较基准增长率为0.52%。
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

姓名	项目	金额(元)	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	178,042,983.50	67.70
	其中:债券	178,042,983.50	67.70
	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	29,700,164.55	11.29
	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	52,179,263.37	19.84
8	其他资产	3,054,065.99	1.16
9	合计	262,976,477.41	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资产。
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资产。
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	3,808,879.00	1.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,049,000.00	4.38
	其中:政策性金融债	10,049,000.00	4.38
4	企业债券	49,293,104.50	21.50
5	企业短期融资券	110,100,000.00	48.03
6	中期票据	4,792,000.00	2.09
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	178,042,983.50	77.67

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	011698139	16陆家嘴SCP001	200,000	20,062,000.00	8.75
2	011759022	17物产中大SCP004	200,000	20,002,000.00	8.73
3	011752009	17深能源SCP001	200,000	19,998,000.00	8.72
4	011697008	16滨海建投SCP001	200,000	19,982,000.00	8.72
5	112138	12苏宁01	141,000	14,170,500.00	6.18

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
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,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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,772.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,044,293.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,054,065.99

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
本基金本报告期末未持有股票资产。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	246,570,804.49
报告期期间基金总申购份额	22,443.12
减:报告期期间基金总赎回份额	15,464,176.74
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	231,129,070.87

§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。
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,基金管理人无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,富安达长盈保本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2日,富安达长盈保本混合型证券投资基金的关联交易公告
7.2017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
8.2017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蚂蚁(杭州)基金销售有限公司费率优惠活动的公告
9.2017年3月27日,富安达长盈保本混合型证券投资基金2016年年度报告
10.2017年3月27日,富安达长盈保本混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

§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长盈保本混合型证券投资基金设立的文件:
《富安达长盈保本混合型证券投资基金招募说明书》;
《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》;
《富安达长盈保本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

富安达优势成长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1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富安达优势成长混合
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	862,445,272.31份
投资目标	本基金定位为混合型证券投资基金。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,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	本基金属于混合型证券投资基金,属于证券投资基金中预期风险和预期收益较高的基金产品,其预期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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-14,018,875.53
2.本期利润	88,898,137.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.1009
4.期末基金资产净值	1,583,126,879.03
5.期末基金份额净值	1.836

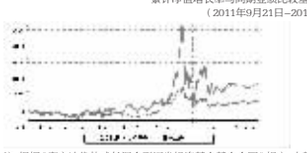
注:①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.80%	0.71%	3.37%	0.39%	2.43%	0.32%

注: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

富安达优势成长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
(2011年9月21日-2017年3月31日)



注:根据《富安达优势成长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		
吴战峰	本基金的基金经理、公司研究发展部总监	2016年1月9日	-	22年	硕士。历任中大投资公司投资部经理,平安证券资产管理部投资经理,招商证券研发中心高级分析师,国信证券研究所首席分析师,国投瑞银基金高级组合经理,国泰基金基金经理,天治基金基金经理,总经理助理兼研究总监。2015年10月加入富安达基金管理有限公司任研究发展部总监。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达优势成长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》。
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。
4.3.2 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
一季度市场整体表现活跃,家电家居、白酒、医药、电子等行业的蓝筹股表现良好,投资品行业如煤炭、有色等行业则整体冲高回落。本基金在一季度延续去年四季度的投资策略,重点布局了低估值的家电、白酒行业以及生物医药、芯片、汽车及零配件等新兴成长性行业,并增加了航空业的投资、减持了石化、化工行业的配置。
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1.8356元,本报告期份额净值增长率为5.80%,同期业绩比较基准增长率为3.37%。
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	1,493,886,833.53	93.68
	其中:股票	1,493,886,833.53	93.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,392,000.00	5.04
	其中:债券	80,392,000.00	5.04
	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	16,040,541.65	1.01
8	其他资产	4,283,858.02	0.27
9	合计	1,594,603,233.20	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	1,168,865,621.25	73.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,641,945.19	0.80
E	建筑业	25,305,500.00	1.60
F	批发和零售业	4,394,023.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	265,995,537.07	16.80
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	-	-
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	6,421,823.60	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,262,383.42	0.65
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,493,886,833.53	94.36

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	002399	海普瑞	4,359,636	90,898,410.60	5.74
2	000858	五粮液	1,899,703	81,687,229.00	5.16
3	603005	晶方科技	2,415,576	81,115,042.08	5.12
4	601111	中国国航	9,425,447	78,136,955.63	4.94
5	603306	华懋科技	2,078,013	73,561,660.20	4.65
6	600221	海南航空	21,000,000	72,450,000.00	4.58
7	600584	长电科技	3,719,389	70,222,064.32	4.44
8	002415	海康威视	2,187,939	69,795,254.10	4.41
9	002273	水晶光电	2,992,757	67,935,583.90	4.29
10	002185	华天科技	4,903,448	65,068,754.96	4.11

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	80,392,000.00	5.08
	其中:政策性金融债	80,392,000.00	5.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	80,392,000.00	5.08

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	140220	14国开20	800,000	80,392,000.00	5.08

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,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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,004,016.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,455,114.48
5	应收申购款	824,727.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,283,858.02

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	894,832,622.23
报告期期间基金总申购份额	7,643,552.77
减:报告期期间基金总赎回份额	40,030,902.69
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	862,445,272.31

§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	27,183,886.56
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	27,183,886.56
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.15

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,富安达优势成长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23日,富安达基金管理有限公司关于副总经理任职的公告
7.2017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蚂蚁(杭州)基金销售有限公司费率优惠活动的公告
8.2017年3月27日,富安达优势成长混合型证券投资基金2016年年度报告
9.2017年3月27日,富安达优势成长混合型证券投资基金2016年年度报告摘要
10.2017年3月29日,富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠的公告

§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优势成长混合型证券投资基金设立的文件:
《富安达优势成长混合型证券投资基金招募说明书》;
《富安达优势成长混合型证券投资基金基金合同》;
《富安达优势成长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

富安达增强收益债券型证券投资基金

【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	45,324,372.53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,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。 在进行固定收益类资产配置时,本基金首先通过久期配置、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。本基金的股票类资产作为整体基金投资组合管理的辅助工具,为投资人提供适度参与股票市场、获取超额收益的机会。
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	20,569,744.12份	24,754,628.41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	-261,030.67	-360,956.10
2.本期利润	-22,662.30	60,742.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0013	0.0024
4.期末基金资产净值	23,781,138.07	28,057,185.11
5.期末基金份额净值	1.1561	1.1334

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	0.12%	0.44%	-0.03%	0.12%	0.15%	0.32%

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	0.02%	0.45%	-0.03%	0.12%	0.05%	0.33%

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