

## 富安达长盈保本混合型证券投资基金

### 2017年第四季度报告

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:2018年1月20日

#### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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法律责任。基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司承诺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法律责任。基金管理人承诺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法律责任。基金托管人承诺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法律责任。基金管理人承诺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法律责任。基金托管人承诺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法律责任。

§2 基金产品概况	
基金名称	富安达长盈保本混合
基金代码	000084
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	953,509,342.69份
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的资产,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	业绩比较基准:沪深300指数收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为保本混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金,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	上海浦东发展银行股份有限公司
基金销售人	中国银行股份有限公司

#### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
1.本期已实现收益	-3,306,294.79元
2.本期利润	-3,304,213.97元
3.本期基金份额净值增长率	0.0101%
4.本期基金资产净值	188,060,076.94元
5.本期基金份额净值	1.0081

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。

3.2.1 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 基准收益 ②	业绩比较 基准收益 ③	业绩比较 基准收益 和基准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.08%	0.12%	0.53%	0.01%	1.46%	0.11%

注:注:①本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率。  
②本基金的业绩比较基准按照构建为交易对日进行计算,按下列公式计算:

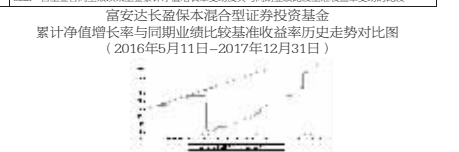
$$Return_t = \text{今日指数} / \text{昨日指数} - 1$$

$$Benchmark_t = (1 + Return_t) \times Benchmark_{t-1}$$

$$t = 1, 2, 3, \dots, T$$

T表示时间截至日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动与业绩比较基准收益率变动的比较	
富安达长盈保本混合证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2016年5月11日-2017年12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。  
建仓期结束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

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:2018年01月20日

#### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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法律责任。基金托管人交通银行股份有限公司承诺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法律责任。基金管理人承诺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法律责任。基金托管人承诺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法律责任。基金管理人承诺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法律责任。基金托管人承诺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法律责任。

§2 基金产品概况	
基金名称	富安达现金通货币
基金代码	010601
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	6972,824,566.69份
投资目标	本基金在保持基金资产安全性和高流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金管理人采用自上而下的投资策略,综合考虑宏观经济、货币政策、利率走势、市场流动性等因素,进行资产配置,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	业绩比较基准:人民币银行活期存款基准利率+0.5%
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,其风险和收益低于股票型基金和混合型基金,高于债券型基金。
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
基金销售人	富安达基金管理有限公司
基金合同生效日	2013年01月29日
报告期末基金份额总额	6972,824,566.69份
基金合同生效日	2013年01月29日
报告期末基金份额总额	6972,824,566.69份

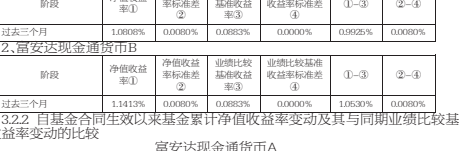
#### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
1.本期已实现收益	2,071,839.96元
2.本期利润	2,086,741.85元
3.本期基金份额净值增长率	342.51% (年化)
4.本期基金资产净值	342,518,886.96元
5.本期基金份额净值	1.0000%

注:①本基金业绩比较基准为:人民币银行活期存款基准利率+0.5%。  
②本基金于2013年1月29日成立,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2013年7月29日。建仓期结束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。

#### §3.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动与业绩比较基准收益率变动的比较

富安达现金通货币A 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-2017年12月31日)	
--	--



注:本基金于2013年1月29日成立,本基金建仓期为6个月,建仓截止日为2013年7月29日。建仓期结束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。

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:2018年1月20日

#### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事承诺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法律责任。基金托管人交通银行股份有限公司承诺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法律责任。基金管理人承诺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法律责任。基金托管人承诺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法律责任。基金管理人承诺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法律责任。基金托管人承诺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法律责任。

§2 基金产品概况	
基金名称	富安达消费主题灵活配置混合
基金代码	000649
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年01月21日
报告期末基金份额总额	676,424,834.05份
投资目标	本基金主要投资于具有良好流动性的资产,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	业绩比较基准:沪深300指数收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,属于证券投资基金中的中风险品种,预期风险和收益低于股票型基金,高于债券型基金。
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

#### §3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	
1.本期已实现收益	-777,250.29元
2.本期利润	-14,860,100.70元
3.本期基金份额净值增长率	0.0106%
4.本期基金资产净值	602,880,302.73元
5.本期基金份额净值	1.0043

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2017年8月1日成立。

主要财务指标	报告期(2017年10月1日-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	-737,226.29
2.本期利润	14,860,100.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0196
4.期末基金资产净值	692,800,302.73
5.期末基金份额净值	1.0243

注:①本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率。  
②本基金的业绩比较基准按照构建为交易对日进行计算,按下列公式计算:

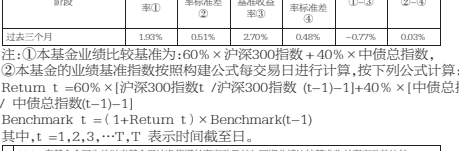
$$Return_t = \text{今日指数} / \text{昨日指数} - 1$$

$$Benchmark_t = (1 + Return_t) \times Benchmark_{t-1}$$

$$t = 1, 2, 3, \dots, T$$

T表示时间截至日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动与业绩比较基准收益率变动的比较	
富安达消费主题灵活配置混合证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2017年8月1日-2017年12月31日)	



注:本基金于2017年8月1日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。本基

## 富安达长盈保本混合型证券投资基金

### 2017年第四季度报告

#### 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	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
李飞	本基金的基金经理	2016年01月11日	-	13年
张瑞瑞	本基金的基金经理	2016年07月23日	-	9年

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,其任职日期为基金合同生效日;担任离任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暂行办法的相关规定。

3、基金经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》及各项法律法规、《富安达长盈保本混合型证券投资基金合同》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。

#### 4.2 公平交易专项说明

4.2.1 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督体系,涵盖了所有投资组合,并贯穿了授权、研究、分析、投资、交易、执行、业绩评估、监督检查各环节,确保公平对待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 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调整态势,临近年末流动性十分紧张,债券、存单、资金利率均快速上行,市场情绪较为谨慎。通胀预期的回升,市场对监管趋严的担忧、美债利率上行等因素对国内债市情绪产生干扰。央行行权文指出,防止发系统性的金融风险是金融工作的根本任务,发展多层次金融杠杆率是金融稳定性的基础,要健全货币政策和宏观审慎政策双支柱调控框架。因此,我们认为去杠杆仍将是未来一段时间的主旋律,货币政策预计保持中性。报告期内本基金净值稳步增长,我们将市场调整之时进行了一些调仓,获得了一定的投资收益。

#### 4.5 报告期内基金的投资组合报告

#### 4.5.1 报告期末按资产类别的股票投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	1,569,215.00	0.05
2	央行票据	9,992,000.00	0.33
3	金融债	9,992,000.00	0.33
4	企业债	-	-
5	中期票据	70,240,000.00	4.19
6	短期融资券	82,812,000.00	4.82
7	其他	-	-
8	合计	164,606,215.00	8.90

#### 4.5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11174218 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
2	11179102 17交通银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
3	11179426 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
4	11179426 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
5	11179426 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
6	11179426 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
7	11179426 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
8	11179426 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
9	11179426 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
10	11179426 17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03

#### 4.5.3 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	11174218	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
2	11179102	17交通银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
3	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
4	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
5	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
6	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
7	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
8	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
9	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
10	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03

#### 4.5.4 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支持证券

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	11174218	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
2	11179102	17交通银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
3	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
4	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
5	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
6	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
7	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
8	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
9	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
10	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03

#### 4.5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券

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	11174218	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
2	11179102	17交通银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
3	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
4	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
5	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
6	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
7	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
8	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
9	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
10	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03

#### 4.5.6 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权证支持证券

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	11174218	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
2	11179102	17交通银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
3	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
4	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
5	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
6	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
7	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
8	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
9	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
10	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03

#### 4.5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证支持证券

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	11174218	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
2	11179102	17交通银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03
3	11179426	17广发银行CD181	200,000	19,546,000.00	11.03