

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基金经理保证本基金所披露的信息不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对基金的内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担责任。基金持有人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的基金合同和招募说明书。基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺不从事内幕交易、利益输送等违法违规行为,勤勉尽责地管理基金资产和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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基金合同和招募说明书。

本报告期无财务报告附注。

本报告期(2017年10月1日至2017年12月31日)。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富安达长盈保本混合型证券投资基金
基金代码	002684
基金运作方式	契约型开放式
基金经理的任职日期	2016年6月11日
基金合同生效日	2016年6月11日
报告期末基金份额总额	961,509,344.00份
投资目标	本基金通过CPPI策略进行仓位调整操作,动态调整资产与风险资产在基金资产中的配置比例,以期在保证本金安全的基础上实现资产的保值增值。
投资策略	本基金在综合考虑CPPI策略的仓位调整操作,动态调整资产与风险资产在基金资产中的配置比例,以期在保证本金安全的基础上实现资产的保值增值。本基金在投资运作中,将严格遵守《证券投资基金法》、《基金合同》、《基金招募说明书》、《基金托管协议》、《基金运作办法》等法律法规的规定,在严格控制风险的前提下,通过科学严谨的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	业绩比较基准:定期存款(1-1)+40%×[中债总指数(1-1)-定期存款指数]
风险收益特征	本基金为保本型基金,属于中低风险品种。投资者投资于本基金,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
基金销售代理人	中国银河证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

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	-3,526,944.29
2.本期利润	3,304,201.00
3.期末可供分配基金份额利润	0.0010
4.期末基金资产净值	160,002,676.74
5.期末基金份额净值	1.000

注:1)本基金财务指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用影响到基金净值水平时除外。

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)扣除必要的费用后的余额,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11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	业绩比较基准收益率	差额	差额收益率
过去三个月	1.98%	0.12%	0.85%	0.01%
	1.40%	0.11%	1.29%	0.11%

注:①本基金业绩比较基准为:二年定期存款基准收益率+0.05%。

②本基金的业绩基准指按照约定构建不同交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =今日指数(t-1) - 1

Benchmark t = (1+Return t) * Benchmark(t-1)

其中,t=1,2,3,...,T,表示报告期天数。

3.2.2 百慕达综合生息账户余额及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

流动性限制。

4.2.1 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 报告期内基金的费用调整和运作费分摊

报告期内债券市场调整态势,近年来流动性十分紧张,债券、存单、资金利率均快速上升,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、美债利率上升等因素对国内市场情绪产生干扰。央行行长撰文指出,防止发生系统性金融风险是金融工作的根本性任务,宏观层面金融杠杆率是金融脆弱性的总根源,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要任务,货币政策预计保持中性。报告期内本基金净值稳步增长,我们对市场调整时进行了一次调仓,获得了一定的投资收益。

4.4.2 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。

4.4.3 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.4 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.5 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.6 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.7 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.8 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.9 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.10 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.11 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.12 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.13 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.14 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.15 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.16 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.17 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。

4.4.18 公平交易专项说明

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》,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制度和风险控制体系,涵盖所有投资品种,包括股票、债券、基金等投资品种,确保在投资决策、交易执行、业绩评估、合规监督等环节,公平对待待组合的每一个投资组合。本报告期内,公司严格执行了《证券投资基金法》、《公平交易制度指引》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截至报告日,公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析,按绝对值定期排名,分1日、3日和5日的期间分析同时向反向交易的价格差异,未发现公平交易异常。