

富安达现金货币市场证券投资基金

2016年第3季度报告

2016年09月30日

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24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2016年10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2016年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	富安达现金货币
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	328,602,419.57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	富安达现金货币A	富安达现金货币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	118,394,148.25份	210,208,271.32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（2016年07月01日-2016年09月30日）	
	富安达现金货币A	富安达现金货币B
1. 本期已实现收益	288,265.73	1,952,136.24
2. 本期利润	288,265.73	1,952,136.24
3. 期末基金资产净值	118,394,148.25	210,208,271.32

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其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、富安达现金货币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	0.7101%	0.0168%	0.0883%	0.0000%	0.6218%	0.0168%

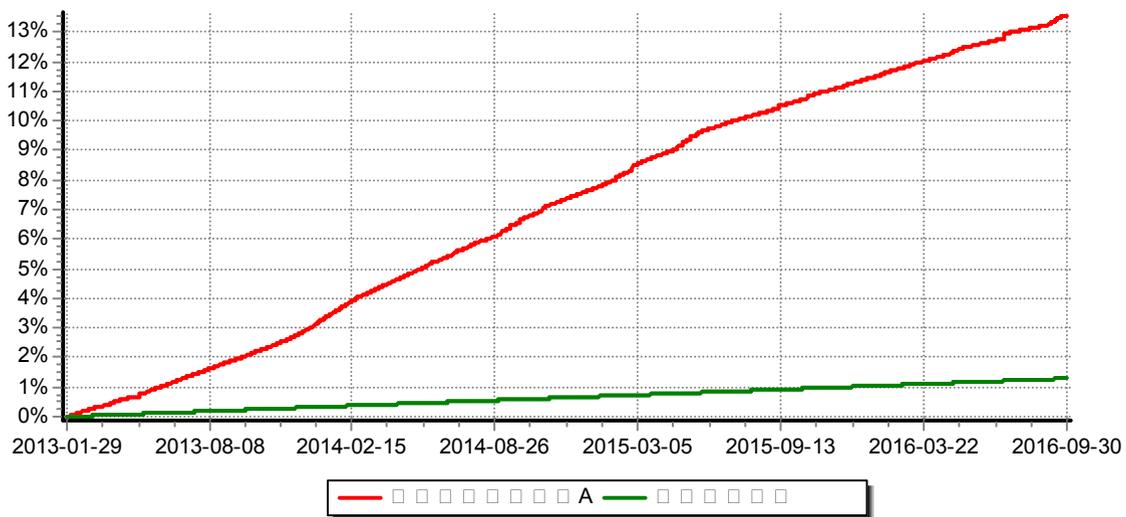
2、富安达现金货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	---------	---------------	-----	-----

		准差②	收益率 ③	准差④		
过去三个月	0.7701 %	0.0168 %	0.0883 %	0.0000%	0.6818 %	0.0168 %

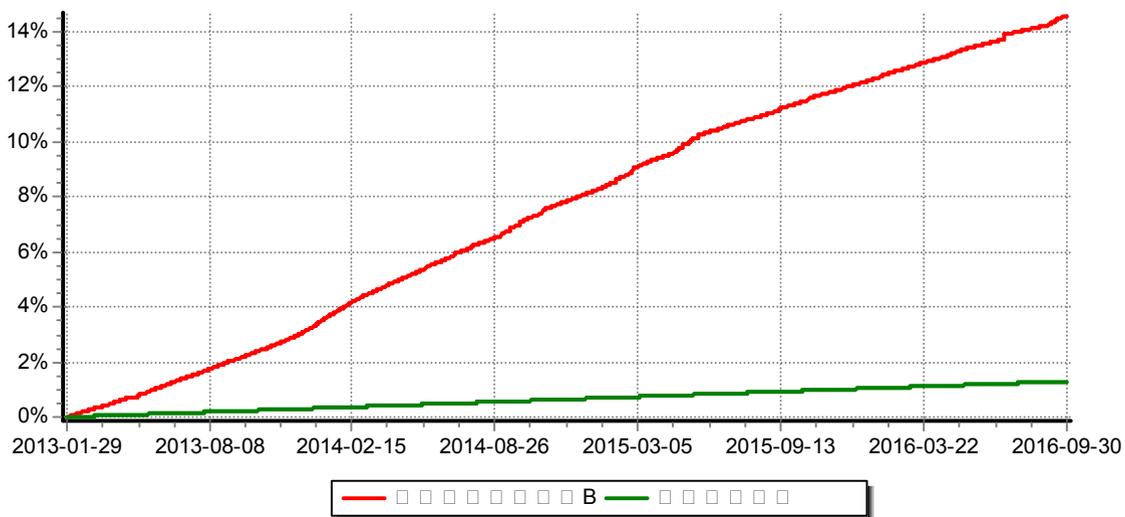
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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-2016年09月30日)



注：本基金于2013年1月29日成立。根据《富安达现金货币市场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。

富安达现金货币B
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-2016年09月30日)



注：本基金于2013年1月29日成立。根据《富安达现金货币市场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、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、富安达长盈保	2013年01月29日	—	8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

	本混合型证券投资基金基金经理				
--	----------------	--	--	--	--

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、《富安达现金货币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

报告期内季度初债市行情整体向好，资金面较为宽松，长端利率下行较多，一级债券投标火热，认购倍数高涨。随后随着月底资金趋紧，债市进入调整，利率债陡峭

上行，一级市场投标略有降温。报告期内资产荒逻辑是影响债市上涨的核心因素，房地产一枝独秀、房贷增量占贷款和社融比重上升到历史新高，显示其他融资需求极度萎靡。贷款、非标、票据等资产的萎缩使得金融机构缺资产的状况愈发严重，理财配置压力存在，资产配置需求大部分转向到债券。而八月及九月下旬以来的债市调整，主要基于前期迅速上涨的技术性回调、央行重启十四天逆回购引发的对于货币政策取向和去杠杆的担忧。信用市场方面，报告期内债券信用评级调整趋于平静，落后产能行业淘汰产能及债务处理进行中，信用债基本面保持平稳但信用风险依然未消。报告期内我们主要根据市场的波动情况对组合债券持仓进行了调整，并根据基金规模变动情况对其他组合资产进行了动态调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内富安达现金货币A份额净值收益率为0.7101%，富安达现金货币B份额净值收益率为0.7701%，同期业绩比较基准收益率为0.0883%。

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

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	190,437,121.83	57.83
	其中：债券	190,437,121.83	57.83
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	132,859,788.70	40.34
4	其他资产	6,030,991.87	1.83
5	合计	329,327,902.40	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 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	5.85	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2016年07月 13日	22.50	巨额赎回	1天

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。根据本基金的基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过120天，下同。

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	25.22	—
	其中：剩余存续期超过397天	—	—

	的浮动利率债		
2	30天(含)—60天	9.13	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	33.48	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	6.12	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	24.42	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	98.37	—

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。

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

注：本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	30,143,270.38	9.17
	其中：政策性金融债	30,143,270.38	9.17
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	160,293,851.45	48.78
6	中期票据	—	—
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—

9	合计	190,437,121.83	57.95
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150408	15农发08	200,000	20,145,482.73	6.13
2	041664002	16武清国资CP001	200,000	20,114,532.19	6.12
3	041664020	16张家公资CP001	200,000	20,039,516.99	6.10
4	041662012	16昆山创业CP001	200,000	20,036,777.77	6.10
5	041664015	16兵国资CP001	200,000	20,034,554.01	6.10
6	041558105	15蒙中电CP001	200,000	20,030,174.98	6.10
7	041559071	15吴江城投CP002	200,000	20,016,807.65	6.09
8	041558099	15渤海租赁CP001	200,000	20,015,823.56	6.09
9	041555040	15康美CP002	200,000	20,005,664.30	6.09
10	150222	15国开22	100,000	9,997,787.65	3.04

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	34
报告期内偏离度的最高值	0.3516%
报告期内偏离度的最低值	0.1144%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2434%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

本基金采用1.00固定单位净值交易方式，自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金持有人，并按月结转到投资人基金账户。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	4,452,682.37
4	应收申购款	1,578,309.50
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	6,030,991.87

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达现金货币A	富安达现金货币B
报告期期初基金份额总额	25,264,816.88	673,377,534.66

报告期基金总申购份额	264,854,846.77	136,925,076.43
减：报告期基金总赎回份额	171,725,515.40	600,094,339.77
报告期期末基金份额总额	118,394,148.25	210,208,271.32

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2016年09月 07日	6,500,000.00	6,500,000.00	—

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

1. 2016年7月1日，富安达基金管理有限公司2016年6月30日基金净值公告；
2. 2016年7月18日，富安达基金管理有限公司关于参加兴业证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告；
3. 2016年7月20日，富安达现金货币市场证券投资基金2016年第2季度报告；
4. 2016年8月26日，富安达现金货币市场证券投资基金2016年半年度报告（摘要）；
5. 2016年8月26日，富安达现金货币市场证券投资基金2016年半年度报告；
6. 2016年9月9日，富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书更新（二〇一六年第二号）；
7. 2016年9月9日，富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书更新（二〇一六年第二号）摘要；
8. 2016年9月13日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加华龙证券股份有限公司为代销机构并参与费率优惠活动的公告；
9. 2016年9月13日，富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加光大证券股份有限公司为代销机构并参与费率优惠活动的公告；
10. 2016年9月20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；
11. 2016年9月26日，关于富安达现金货币市场证券投资基金2016年国庆假期前暂停大额申购（含定投及转换转入）业务的公告；
12. 2016年9月27日，富安达基金管理有限公司关于修改富安达现金货币市场证券投资基金基金合同和托管协议的公告；
13. 2016年9月27日，富安达现金货币市场证券投资基金基金合同；

14. 2016年9月27日，富安达现金货币市场证券投资基金托管协议。

§ 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现金货币市场证券投资基金设立的文件：
《富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书》；
《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》；
《富安达现金货币市场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
二〇一六年十月二十四日