

富安达现金货币市场证券投资基金2016年年度报告

2016年12月31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

送出日期：2017年3月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 债券回购融资情况	45
8.3 基金投资组合平均剩余期限	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细	47
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	47
8.8 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	48
8.9 投资组合报告附注	48
§9 基金份额持有人信息	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§10 开放式基金份额变动	50
§11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50

11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4	基金投资策略的改变	52
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	52
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
11.7	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	52
11.8	其他重大事件	52
§12	备查文件目录	56
12.1	备查文件目录	56
12.2	存放地点	56
12.3	查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达现金货币市场证券投资基金	
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1月29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	
报告期末基金份额总额	399,526,852.00份	
基金合同存续期	不定期	
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	63,413,250.46份	336,113,601.54份

2.2 基金产品说明

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	本基金属于货币市场基金，属于低风险产品。一般情况，其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金

	和债券型基金。
--	---------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋晓刚	陆志俊
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999（免长途） 021-61870666	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道 1568号中建大厦29楼	上海市浦东新区银城中路 188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道 1568号中建大厦29楼	上海市浦东新区银城中路 188号
邮政编码		200122	200120
法定代表人		秦雁	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特 殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路202号 企业天地2号楼普华永道中心11 楼
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号 中建大厦29楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年		2015年		2014年	
	富安达现金货币A	富安达现金货币B	富安达现金货币A	富安达现金货币B	富安达现金货币A	富安达现金货币B
本期已实现收益	1,176,360.80	8,578,849.46	1,242,952.78	7,260,119.58	1,422,156.82	5,033,757.23
本期利润	1,176,360.80	8,578,849.46	1,242,952.78	7,260,119.58	1,422,156.82	5,033,757.23
本期净值收益率	2.6462%	2.8926%	3.4405%	3.6892%	4.3618%	4.6131%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末基金资产净值	63,413,250.46	336,113,601.54	27,998,078.06	635,660,110.05	22,205,727.88	134,254,249.59
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016年末		2015年末		2014年末	
累计净值收益率	14.3174%	15.4007%	11.3703%	12.1564%	7.6661%	8.1659%

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 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

阶段 (富安达现金货币A)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.6808%	0.0110%	0.0883%	0.0000%	0.5925%	0.0110%
过去六个月	1.3957%	0.0142%	0.1766%	0.0000%	1.2191%	0.0142%
过去一年	2.6462%	0.0105%	0.3516%	0.0000%	2.2946%	0.0105%
过去三年	10.8089%	0.0108%	1.0565%	0.0000%	9.7524%	0.0108%
自基金合同生效日起至今（2013年01月29	14.3174%	0.0100%	1.3836%	0.0000%	12.9338%	0.0100%

日-2016年12月31日)						
----------------	--	--	--	--	--	--

阶段 (富安达现金货币B)	份额净 值收益 率①	份额净 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	0.7420 %	0.0110 %	0.0883 %	0.0000 %	0.6537 %	0.0110 %
过去六个月	1.5178 %	0.0142 %	0.1766 %	0.0000 %	1.3412 %	0.0142 %
过去一年	2.8926 %	0.0105 %	0.3516 %	0.0000 %	2.5410 %	0.0105 %
过去三年	11.6102 %	0.0108 %	1.0565 %	0.0000 %	10.5537 %	0.0108 %
自基金合同生效日起 至今(2013年01月29 日-2016年12月31日)	15.4007 %	0.0100 %	1.3836 %	0.0000 %	14.0171 %	0.0100 %

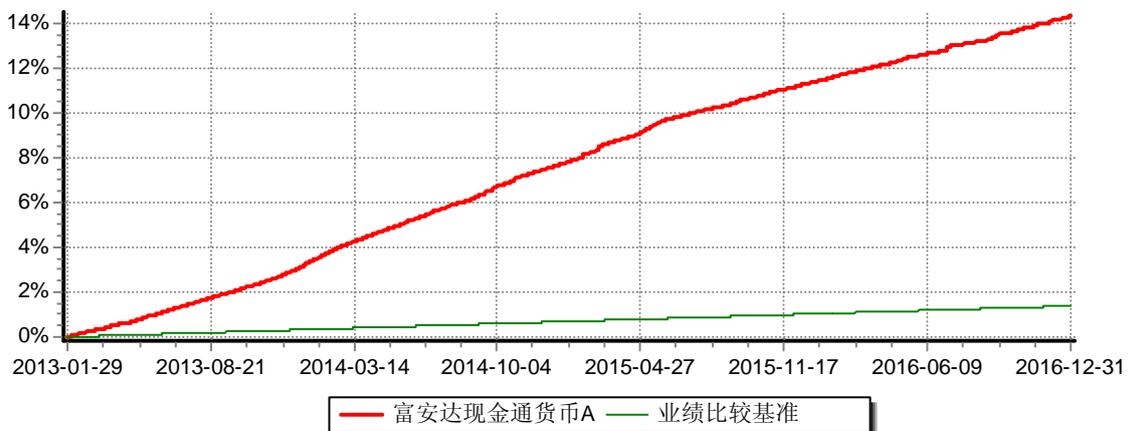
注：本基金业绩比较基准为同期活期存款利率（税后）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

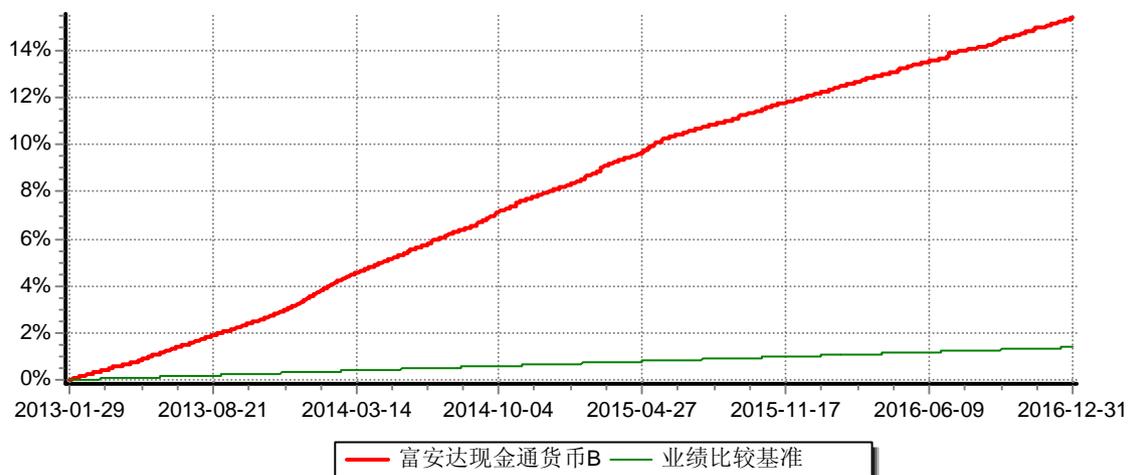
富安达现金货币A

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1月29日-2016年12月31日)

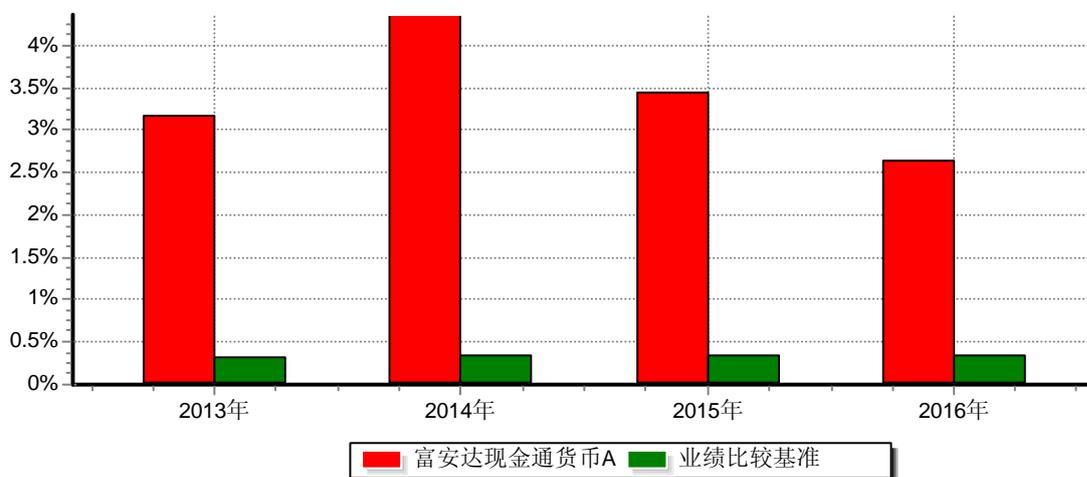


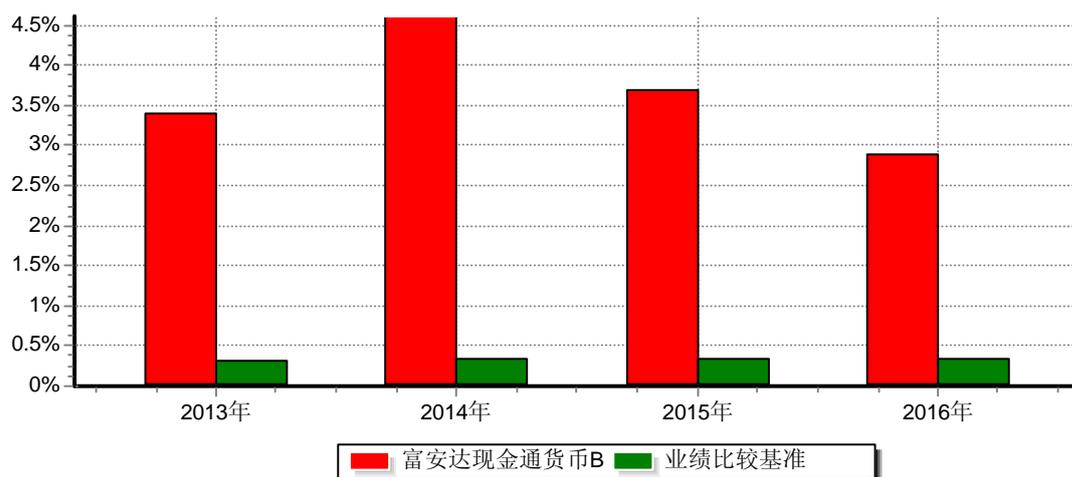
富安达现金货币B
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年1月29日-2016年12月31日)



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：基金合同生效当年的净值收益率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

富安达现金货币A

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	1,171,505.11	—	4,855.69	1,176,360.80	
2015年	1,243,040.72	—	-87.94	1,242,952.78	
2014年	1,424,905.66	—	-2,748.84	1,422,156.82	
合计	3,839,451.49	—	2,018.91	3,841,470.40	

富安达现金货币B

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	8,585,438.22	—	-6,588.76	8,578,849.46	
2015年	7,228,087.02	—	32,032.56	7,260,119.58	
2014年	5,077,408.27	—	-43,651.04	5,033,757.23	
合计	20,890,933.51	—	-18,207.24	20,872,726.27	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本2.88亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2016年12月31日，公司共管理8只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈保本混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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1月29日	—	8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1月起任富安达现金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、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合规守信情况的说明

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、《富安达现金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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内债券市场整体先扬后抑呈震荡市，年初受央行降准影响，流动性整体较为宽裕。上半年信用债违约风险和主体评级下调事件频繁暴露，涉及违约和评级下调的企业涉及各等级各行业，包含央企、国企、民企和外资企业，其中“两高一剩”行业居多。下半年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，信用债基本面较上半年而言较为平稳，但信用风险依然未消。信用债市场出现分化，同等级不同行业利差分化持续，产业债和城投债分化较为明显。报告期内，国际方面，美联储加

息、英国脱欧、美国总统选举、全球避险情绪上升、人民币持续贬值等，对国内债市不时形成压力。国内方面，央行公开市场“锁短放长”的操作导致资金成本不时波动，市场情绪也上下起伏。报告期内货币基金新规施行，我们根据新的法规要求及时调仓以符合相关规定，并根据基金规模变动情况和市场行情对本基金的组合资产进行了动态调整。

4.4.2 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2.6462%，富安达现金货币B份额净值收益率为2.8926%，同期业绩比较基准收益率为0.3516%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行春节前后上调MLF利率和逆回购利率，引发了市场对于加息的争议，市场风险偏好回落。在数量上央行确保流动性的稳定，而价格略微上调则体现了央行去杠杆、抑泡沫的态度。年初由于担心央行进一步紧缩，债券收益率从年初以来有较大幅度的上升，10年国债一度升至接近3.5%的水平，10年期国开债收益率也升至4.2%的水平。我们预判从经济基本面和货币政策去杠杆的目标来看，暂时不支持债券收益率明显回落，但我们认为债券收益率进一步上升的空间较为有限。所以从交易角度来看，债券机会暂时不明显；但从配置角度来看，我们会择机配置中高等级有配置价值的债券。预计近期债市会曲折震荡前行，我们会择机把握好债市交易机会。此外，我们还将继续关注宏观经济和债券市场的走势，根据市场情况和规模变动情况适时调整组合资产，在维持流动性和安全性的前提下力争获得较高的收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设，强化内部管理，不断提升自身合规风控能力。报告期内，公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，强化内控基础建设；牵头开展了多形式的合规培训，强化员工职业道德教育和合规意识培育，从源头上防范合规风险；建立健全防控内幕交易机制，确保基金投资的独立性、公平性和合规性；加强业务日常合规审核和合规监测，并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查，确保各项法规和管理制度有效落实，使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全全面风险管理体系，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保护基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金每日计算分配收益，收益分配采用红利再投资方式，按月结转份额。本报告期内本基金A类收益分配金额为1,176,360.80元，B类收益分配金额为8,578,849.46元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016年度，托管人在富安达现金货币市场证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016年度，富安达基金管理有限公司在富安达现金货币市场证券投资基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：1,176,360.80元，向B级份额持有人分配利润：8,578,849.46元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016年度，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达现金货币市场证券投资基金的年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第21985号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富安达现金货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富安达现金货币市场证券投资基金(以下简称"富安达现金通基金")的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是富安达现金通基金的基金管理人富安达基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财</p>

	<p>务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述富安达现金通基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了富安达现金通基金 2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	陈玲、都晓燕
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
审计报告日期	2017-03-23

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富安达现金货币市场证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	159,507,209.81	247,000,000.00
结算备付金		—	21,985,908.41
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	120,156,593.94	140,536,880.60

其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		120,156,593.94	140,536,880.60
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	117,597,856.41	250,001,095.00
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	2,856,522.31	3,971,877.49
应收股利		—	—
应收申购款		79,795.00	830,779.24
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		400,197,977.47	664,326,540.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		2,098.52	9,940.36
应付管理人报酬		83,657.72	126,372.06
应付托管费		25,350.80	38,294.55
应付销售服务费		19,054.82	9,072.34
应付交易费用	7.4.7.7	8,163.95	10,082.43
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		43,798.18	45,531.25

递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	489,001.48	429,059.64
负债合计		671,125.47	668,352.63
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	399,526,852.00	663,658,188.11
未分配利润	7.4.7.10	—	—
所有者权益合计		399,526,852.00	663,658,188.11
负债和所有者权益总计		400,197,977.47	664,326,540.74

注：报告截止日2016年12月31日，富安达现金货币市场证券投资基金A类和B类基金份额净值均为1.0000元，基金总份额399,526,852.00份，其中A类基金份额总额63,413,250.46份，B类基金份额总额336,113,601.54份。

7.2 利润表

会计主体：富安达现金货币市场证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年01月01日至 2015年12月31日
一、收入		12,070,413.92	10,179,507.23
1.利息收入		11,677,327.76	8,985,960.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,751,022.94	5,269,031.95
债券利息收入		5,331,669.61	3,217,383.10
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		594,635.21	499,545.09
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		393,086.16	1,193,547.09
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	393,086.16	1,193,547.09

资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	—	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	—	—
减：二、费用		2,315,203.66	1,676,434.87
1. 管理人报酬		1,160,109.89	880,307.65
2. 托管费		351,548.41	266,759.86
3. 销售服务费		147,797.75	116,262.04
4. 交易费用		—	—
5. 利息支出		339,797.61	218,965.32
其中：卖出回购金融资产支出		339,797.61	218,965.32
6. 其他费用	7.4.7.19	315,950.00	194,140.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,755,210.26	8,503,072.36
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,755,210.26	8,503,072.36

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达现金货币市场证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	663,658,188.11	—	663,658,188.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		9,755,210.26	9,755,210.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-264,131,336.11	—	-264,131,336.11
其中：1.基金申购款	1,802,560,713.54	—	1,802,560,713.54
2.基金赎回款	-2,066,692,049.65	—	-2,066,692,049.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	-9,755,210.26	-9,755,210.26
五、期末所有者权益（基金净值）	399,526,852.00	—	399,526,852.00
项 目	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	156,459,977.47	—	156,459,977.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	8,503,072.36	8,503,072.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	507,198,210.64	—	507,198,210.64
其中：1.基金申购款	2,290,579,200.94	—	2,290,579,200.94
2.基金赎回款	-1,783,380,990.30	—	-1,783,380,990.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	-8,503,072.36	-8,503,072.36
五、期末所有者权益（基金净值）	663,658,188.11	—	663,658,188.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

蒋晓刚	蒋晓刚	顾颖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富安达现金货币市场证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012] 1440号《关于核准富安达现金货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由富安达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币993,919,179.25元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第25号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》于2013年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为994,024,416.12份基金份额,其中认购资金利息折合105,236.87份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。

根据经批准的《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》和《富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据投资者认(申)购的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,形成A类和B类两类基金份额,其中A类基金份额按照0.25%的年费率计提销售服务费,B类基金份额按照0.01%的年费率计提销售服务费。本基金A类、B类两种收费模式并存,各类基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级,不同基金份额等级之间不得互相转换,但因认购、申购、赎回、基金转换等交易而发生的基金份额自动升级或者降级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括现金、期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在397天以内(397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准:同期活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2017年3月23日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达现金货币市场证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价

值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A、B类份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额等级的基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值1.00元分配后转入所有者权益，每月集中宣告收益分配并将当月收益结转到投资人基金账户。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券

的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	507,209.81	—
定期存款	159,000,000.00	247,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	30,000,000.00	—
其中：存款期限1个月以内	99,000,000.00	217,000,000.00
存款期限3个月以上	30,000,000.00	30,000,000.00
其他存款	—	—
合计	159,507,209.81	247,000,000.00

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2016年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	120,156,593.94	120,188,000.00	31,406.06	0.0079
	合计	120,156,593.94	120,188,000.00	31,406.06	0.0079
项目		上年度末2015年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	140,536,880.60	140,936,000.00	399,119.40	0.0601
	合计	140,536,880.60	140,936,000.00	399,119.40	0.0601

- 注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；
2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	117,597,856.41	—
合计	117,597,856.41	—
项目	上年度末2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	250,001,095.00	—
合计	250,001,095.00	—

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	298.77	474.13
应收定期存款利息	212,652.86	170,491.58
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	1,608.86	2,613.44
应收债券利息	2,434,545.86	3,773,389.17
应收买入返售证券利息	207,415.96	17,370.05
应收申购款利息	—	7,539.12

应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	—	—
合计	2,856,522.31	3,971,877.49

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	—	—
银行间市场应付交易费用	8,163.95	10,082.43
合计	8,163.95	10,082.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	1.48	59.64
预提费用	489,000.00	429,000.00
合计	489,001.48	429,059.64

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 富安达现金货币A

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,998,078.06	27,998,078.06
本期申购	438,911,449.78	438,911,449.78
本期赎回（以“-”号填列）	-403,496,277.38	-403,496,277.38

本期末	63,413,250.46	63,413,250.46
-----	---------------	---------------

7.4.7.9.2 富安达现金货币B

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	635,660,110.05	635,660,110.05
本期申购	1,363,649,263.76	1,363,649,263.76
本期赎回（以“-”号填列）	-1,663,195,772.27	-1,663,195,772.27
本期末	336,113,601.54	336,113,601.54

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润**7.4.7.10.1 富安达现金货币A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	1,176,360.80	—	1,176,360.80
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-1,176,360.80	—	-1,176,360.80
本期末	—	—	—

7.4.7.10.2 富安达现金货币B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	8,578,849.46	—	8,578,849.46
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—

基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-8,578,849.46	—	-8,578,849.46
本期末	—	—	—

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间2015年01 月01日至2015年12月31日
活期存款利息收入	5,551.85	10,298.28
定期存款利息收入	5,690,454.35	5,117,755.52
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	54,940.18	101,454.72
其他	76.56	39,523.43
合计	5,751,022.94	5,269,031.95

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未获得股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	393,086.16	1,193,547.09
债券投资收益——赎回差价 收入	—	—
债券投资收益——申购差价 收入	—	—

合计	393,086.16	1,193,547.09
----	------------	--------------

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成交总额	331,138,561.34	249,072,681.21
减：卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成本总额	320,206,243.22	240,489,544.52
减：应收利息总额	10,539,231.96	7,389,589.60
买卖债券差价收入	393,086.16	1,193,547.09

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未获得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间均未获得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未获得衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未获得股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未获得公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间2015年01 月01日至2015年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	220,000.00	100,000.00
其他	400.00	400.00
帐户维护费	36,000.00	36,000.00
汇划手续费	9,550.00	7,740.00
合计	315,950.00	194,140.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司 ("交通银行")	基金托管人、基金销售机构

南京证券股份有限公司 ("南京证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司 ("江苏交通")	基金管理人的股东
南京市河西新城区国有资产经营控股 (集团) 有限责任公司 ("南京河西")	基金管理人的股东
富安达资产管理 (上海) 有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末无应支付关联方佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年01月 01日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,160,109.89	880,307.65
其中：支付销售机构的客户维护费	163,480.31	102,990.13

注：1、支付基金管理人的基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.33%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间2015年01月
----	----	-----------------

	2016年1月1日至2016年12月31日	01日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	351,548.41	266,759.86

注：1、支付基金托管人的基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日的基金资产净值×0.1%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达现金货币 A	富安达现金货币 B	合计
富安达基金管理有限公司	11,997.87	24,109.83	36,107.70
交通银行股份有限公司	22,794.17	4,884.33	27,678.50
南京证券股份有限公司	7,062.64	307.65	7,370.29
合计	41,854.68	29,301.81	71,156.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达现金货币 A	富安达现金货币 B	合计
富安达基金管理有限公司	15,618.55	19,029.50	34,648.05
交通银行股份有限公司	27,448.80	1,823.37	29,272.17
南京证券股份有限公司	11,595.23	281.01	11,876.24
合计	54,662.58	21,133.88	75,796.46

注：支付基金销售机构的现金通A、B类销售服务费分别按前一日现金通A类基金资产净值0.25%、B

类基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给富安达基金，再由富安达基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×年销售费率/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日		上年度可比期间2015年01月 01日至2015年12月31日	
	富安达现金通 货币A	富安达现金 通货币B	富安达现金通 货币A	富安达现金 通货币B
期初持有的基金份额	—	27,044,982. 43	—	11,115,185. 06
期间申购/买入总份额	—	15,309,066. 43	3,240,699.72	104,156,125 .19
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总 份额	—	6,500,000.0 0	3,240,699.72	88,226,327. 82
期末持有的基金份额	—	35,854,048. 86	—	27,044,982. 43
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	8.97%	—	4.08%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

2. 基金管理人富安达基金在本会计期间申购、赎回本基金的交易委托南京证券及直销办理，无申购、赎回费用。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：人民币元

关联方名称	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日

		持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
富安 达现 金通 货币 B	南京证券		—	20,551,941.03	3.10%
富安 达现 金通 货币 B	富安达资产	14,149,462.70	3.54%	5,020,974.37	0.76%

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金A类基金份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间2015年01月01日 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行活期 存款	507,209.81	5,551.85	—	10,298.28

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，活期存款按银行同业利率计息，定期存款按约定利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2016年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2015年12月31日：同)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

富安达现金货币A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
1,171,505.11	—	4,855.69	1,176,360.80	

富安达现金货币B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
8,585,438.22	—	-6,588.76	8,578,849.46	

注：本基金在本年度累计分配收益9,755,210.26元，其中以红利再投资方式结转入实收基金9,756,943.33元，计入应付收益科目-1,733.07元。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只主动管理型货币型基金，属于中低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风

险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，运用理性分析价值，严格控制风险，通过积极的主动管理优化基金的风险与收益，为投资人带来长期稳定的回报。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、董事会及中国证监会。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行；定期存款存放在具有基金托管资格的广发银行股份有限公司、中信银行股份有限公司和兴业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	80,071,935.79	120,508,046.96
A-1以下	—	—
未评级	40,084,658.15	20,028,833.64
合计	120,156,593.94	140,536,880.60

注：未评级部分为政策性金融债及短期融资券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度可比期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于2016年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格

因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	99,507,209.81	30,000,000.00	30,000,000.00	—	—	—	159,507,209.81
交易性金融资产	20,021,309.74	80,120,273.87	20,015,010.33	—	—	—	120,156,593.94
买入返售金融资产	117,597,856.41	—	—	—	—	—	117,597,856.41
应收利息	—	—	—	—	—	2,856,522.31	2,856,522.31
应收申购款	—	—	—	—	—	79,795.00	79,795.00
资产总计	237,126,375.96	110,120,273.87	50,015,010.33	—	—	2,936,317.31	400,197,977.47
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,098.52	2,098.52
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	83,657.72	83,657.72

应付托管费	—	—	—	—	—	25,350.80	25,350.80
应付销售服务费	—	—	—	—	—	19,054.82	19,054.82
应付交易费用	—	—	—	—	—	8,163.95	8,163.95
应付利润	—	—	—	—	—	43,798.18	43,798.18
其他负债	—	—	—	—	—	489,001.48	489,001.48
负债总计	—	—	—	—	—	671,125.47	671,125.47
利率敏感度缺口	237,126,375.96	110,120,273.87	50,015,010.33	—	—	2,265,191.84	399,526,852.00
上年度末 2015年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	217,000,000.00	30,000,000.00	—	—	—	—	247,000,000.00
结算备付金	21,985,908.41	—	—	—	—	—	21,985,908.41
交易性金融资产	10,001,646.13	10,010,989.18	120,524,245.29	—	—	—	140,536,880.60
买入返售金融资产	250,001,095.00	—	—	—	—	—	250,001,095.00
应收利息	—	—	—	—	—	3,971,877.49	3,971,877.49
应收申购款	54.00	—	—	—	—	830,725.24	830,779.24
资产总计	498,988,703.54	40,010,989.18	120,524,245.29	—	—	4,802,602.73	664,326,540.74
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	9,940.36	9,940.36

应付管理人报酬	—	—	—	—	—	126,372.06	126,372.06
应付托管费	—	—	—	—	—	38,294.55	38,294.55
应付销售服务费	—	—	—	—	—	9,072.34	9,072.34
应付交易费用	—	—	—	—	—	10,082.43	10,082.43
应付利润	—	—	—	—	—	45,531.25	45,531.25
其他负债	—	—	—	—	—	429,059.64	429,059.64
负债总计	—	—	—	—	—	668,352.63	668,352.63
利率敏感度缺口	498,988,703.54	40,010,989.18	120,524,245.29	—	—	4,134,250.10	663,658,188.11

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
假设	2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。		
假设	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
	市场利率上升25个基点	-62,894.17	-135,785.86
	市场利率下降25个基点	62,969.87	136,082.74

注：截至报告期末，本基金未持有受重大利率风险影响的投资品种。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
假设	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。		
假设	3、Beta系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去100个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于100个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	5%		—
	-5%		—

注：截至报告期末，本基金未持有交易性权益类投资(2015年12月31日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015年12月31日：同)。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为120,188,000.00元，无属于第一或第三层次的余额(2015年12月31日：第二层次140,536,880.60元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	120,156,593.94	30.02
	其中：债券	120,156,593.94	30.02
	资产支持证券	—	—

2	买入返售金融资产	117,597,856.41	29.38
	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	159,507,209.81	39.86
4	其他各项资产	2,936,317.31	0.73
5	合计	400,197,977.47	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.88	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

金额单位：人民币元

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	2016-07-13	22.50	巨额赎回	1天

注：本基金本报告期内，不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

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。

8.3.2 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	59.35	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	27.56	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天 (含)	12.52	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	99.43	—

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过240天的情况。

8.5 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	20,069,647.82	5.02

	其中：政策性金融债	20,069,647.82	5.02
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	100,086,946.12	25.05
6	中期票据	—	—
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	120,156,593.94	30.07
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	占基金资产净值 比例(%)
1	150408	15农发08	200,000	20,069,647.82	5.02
2	0416640 02	16武清国资 CP001	200,000	20,021,309.74	5.01
3	0416640 20	16张家公资 CP001	200,000	20,019,253.53	5.01
4	0416640 15	16兵国资 CP001	200,000	20,016,110.83	5.01
5	0416620 12	16昆山创业 CP001	200,000	20,015,261.69	5.01
6	0116982 10	16苏美达 SCP001	200,000	20,015,010.33	5.01

8.7 “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	-0.1280
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1508

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。

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。

报告期内正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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注**8.9.1 基金计价方法说明。**

鉴于货币市场基金的特性，本基金采用摊余成本法计算基金资产净值，即本基金按持有债券投资的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，以摊余的成本计算基金资产净值。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人采用"影子定价"，即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估，当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为"公允价值变动损益"，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

8.9.2

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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

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	2,856,522.31
4	应收申购款	79,795.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	2,936,317.31

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
富安达 现金通 货币A	11,943	5,309.66	5,489,967.2 9	8.66%	57,923,283. 17	91.34%
富安达 现金通 货币B	11	30,555,781. 96	309,371,468 .31	92.04%	26,742,133. 23	7.96%
合计	11,954	33,422.02	314,861,435 .60	78.81%	84,665,416. 40	21.19%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份 额比例
基金管理人所有从业人员持 有本开放式基金	富安达现金通 货币A	32,315.15	0.01%
	富安达现金通 货币B	—	—

	合计	32,315.15	0.01%
--	----	-----------	-------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富安达现金货币A	0
	富安达现金货币B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达现金货币A	0~10
	富安达现金货币B	0
	合计	0~10

注：1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0。
2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0~10万（含）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	富安达现金货币A	富安达现金货币B
基金合同生效日(2013年1月29日)基金份额总额	605,313,583.32	388,710,832.80
本报告期期初基金份额总额	27,998,078.06	635,660,110.05
本报告期期间基金总申购份额	438,911,449.78	1,363,649,263.76
减：本报告期期间基金总赎回份额	403,496,277.38	1,663,195,772.27
本报告期期间基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	63,413,250.46	336,113,601.54

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动：

2016年1月9日，富安达基金管理有限公司发布公告，增聘吴战峰为富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理。基金经理变更事项已向中国基金业协会办理相应手续，并报中国证券监督管理委员会上海证监局备案。

2016年1月30日，富安达基金管理有限公司发布公告，解聘孔学兵为富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理。基金经理变更事项已向中国基金业协会办理相应手续，并报中国证券监督管理委员会上海证监局备案。

2016年7月22日，富安达基金管理有限公司发布公告，增聘张凯瑜为富安达长盈保本混合型证券投资基金基金经理。基金经理变更事项已向中国基金业协会办理相应手续，并报中国证券监督管理委员会上海证监局备案。

2016年12月10日，富安达基金管理有限公司发布《关于富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金清算报告的公告》，李飞、张凯瑜不再担任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。基金经理变更事项已向中国基金业协会办理相应手续，并报中国证券监督管理委员会上海证监局备案。

2016年12月17日，富安达基金管理有限公司发布公告，解聘毛矛为富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金经理，增聘纪青为富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金经理。基金经理变更事项已向中国基金业协会办理相应手续，并报中国证券监督管理委员会上海证监局备案。

根据《公司法》和《富安达基金管理有限公司章程》的规定，富安达基金管理有限公司于2016年2月1日在公司召开职工大会，经与会职工民主投票，免去孔学兵同志职工董事职务，同意金领千同志为富安达基金管理有限公司第二届职工董事。本议案提交股东会审议通过，并上报中国证监会。

根据《公司法》和《富安达基金管理有限公司章程》的规定，富安达基金管理有限公司于2016年12月29日以通讯方式召开2016年第二次股东会，本次会议应到股东代表3名，实到股东代表3名，代表公司表决权总数的100%。会议决议聘请张敏同志为公司股东董事，王旭同志不再担任公司股东董事职务。本议案已上报中国证监会。

2017年1月16日，富安达基金管理有限公司发布《关于副总经理离任的公告》，朱龙芳因退休原因离任富安达基金管理有限公司副总经理一职。高级管理人员变更事项已按规定报中国证监会上海监管局及中国基金业协会备案。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为50,000元人民币。

截至本报告期末，该事务所已向本基金提供4年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富安达基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	指定报刊和公司网站	2016-01-04
2	富安达基金管理有限公司2015年12月31日基金净值公告	指定报刊和公司网站	2016-01-04
3	富安达基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	指定报刊和公司网站	2016-01-07
4	富安达现金货币市场证券投资基金2015年第4季度报告	指定报刊和公司网站	2016-01-20
5	富安达优势成长混合型证券投资	指定报刊和公司网站	2016-01-30

	基金基金经理变更公告		
6	关于富安达现金货币市场证券投资基金2016年春节前两个工作日暂停申购(含定投及转换转入)业务的公告	指定报刊和公司网站	2016-01-30
7	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告	指定报刊和公司网站	2016-02-04
8	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为代销机构及开通定投并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊和公司网站	2016-03-08
9	富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一六年第一号)	公司网站	2016-03-12
10	富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一六年第一号)摘要	指定报刊和公司网站	2016-03-12
11	富安达现金货币市场证券投资基金2015年年度报告摘要	指定报刊和公司网站	2016-03-26
12	富安达现金货币市场证券投资基金2015年年度报告	公司网站	2016-03-26
13	富安达基金管理有限公司关于参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	指定报刊和公司网站	2016-04-11
14	富安达基金管理有限公司关于参加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	指定报刊和公司网站	2016-04-11
15	富安达基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司	指定报刊和公司网站	2016-04-11

	费率优惠活动的公告		
16	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构及开通定投和转换业务的公告	指定报刊和公司网站	2016-04-16
17	富安达现金货币市场证券投资基金2016年第1季度报告	指定报刊和公司网站	2016-04-22
18	富安达基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	指定报刊和公司网站	2016-05-11
19	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构及开通定投和转换业务的公告	指定报刊和公司网站	2016-06-06
20	富安达基金管理有限公司关于参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	指定报刊和公司网站	2016-06-18
21	富安达基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	指定报刊和公司网站	2016-06-29
22	富安达基金管理有限公司2016年6月30日基金净值公告	指定报刊和公司网站	2016-07-01
23	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	指定报刊和公司网站	2016-07-18
24	富安达现金货币市场证券投资基金2016年第2季度报告	指定报刊和公司网站	2016-07-20
25	富安达现金货币市场证券投资基金2016年半年度报告（摘要）	指定报刊和公司网站	2016-08-26
26	富安达现金货币市场证券投资基金2016年半年度报告	公司网站	2016-08-26
27	富安达现金货币市场证券投资	公司网站	2016-09-09

	基金招募说明书更新（二〇一六年第二号）		
28	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	指定报刊和公司网站	2016-09-09
29	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	指定报刊和公司网站	2016-09-13
30	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	指定报刊和公司网站	2016-09-13
31	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	指定报刊和公司网站	2016-09-20
32	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	指定报刊和公司网站	2016-09-26
33	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	指定报刊和公司网站	2016-09-27
34	富安达现金货币市场证券投资基金基金合同	公司网站	2016-09-27
35	富安达现金货币市场证券投资基金托管协议	公司网站	2016-09-27
36	富安达现金货币市场证券投资基金2016年第3季度报告	指定报刊和公司网站	2016-10-24
37	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	指定报刊和公司网站	2016-11-29

	司手机银行申购及定期定额投资 手续费率优惠的公告		
38	富安达基金管理有限公司关于参 与凯石财富基金销售有限公司费 率优惠活动的公告	指定报刊和公司网站	2016-12-09
39	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	指定报刊和公司网站	2016-12-22
40	富安达基金管理有限公司关于旗 下基金参与中国农业银行股份有 限公司开放式公募基金申购及定 投产品费率优惠的公告	指定报刊和公司网站	2016-12-27
41	富安达基金管理有限公司关于旗 下基金参与东海期货认申购及定 期定额投资手续费率优惠的公告	指定报刊和公司网站	2016-12-29
42	富安达基金管理有限公司关于旗 下基金参与中国工商银行"2017 倾心回馈"基金定投优惠活动公 告	指定报刊和公司网站	2016-12-29

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准富安达增强收益债券型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《富安达现金货币市场证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《富安达现金货币市场证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 基金管理人业务资格批件和营业执照
- 12.1.7 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告
- 12.1.8 中国证监会要求的其他文件

12.2 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。

12.3 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

二〇一七年三月二十七日