

富安达现金货币市场证券投资基金2015年半年度报告

2015年6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

送出日期：2015年8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。本半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2015年8月25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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

1.2 目录

§ 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	181,578,516.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	富安达现金货币A	富安达现金货币B
下属两级基金的交易代码	710501	710502
报告期末下属两级基金的份额总额	48,573,209.93份	133,005,306.49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	刘涛	汤嵩彦
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	tangsy@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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金半年度报告备置地点	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)	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6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层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2015年1月1日-2015年6月30日）	
	富安达现金货币A	富安达现金货币B
本期已实现收益	759,281.30	2,792,111.74
本期利润	759,281.30	2,792,111.74
本期净值收益率	2.08%	2.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末基金资产净值	48,573,209.93	133,005,306.49
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)	
累计净值收益率	9.90%	10.54%

注：①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。

②本基金收益分配方式是“按日分配收益，按月结转份额，当日分配的收益参与下一日收益分配”。

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

(1) 富安达现金货币A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(A级)	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
过去一个月	0.2155 %	0.0013 %	0.0288 %	0.0000 %	0.1867 %	0.0013 %
过去三个月	1.0015 %	0.0155 %	0.0873 %	0.0000 %	0.9142 %	0.0155 %
过去六个月	2.0768 %	0.0137 %	0.1737 %	0.0000 %	1.9031 %	0.0137 %

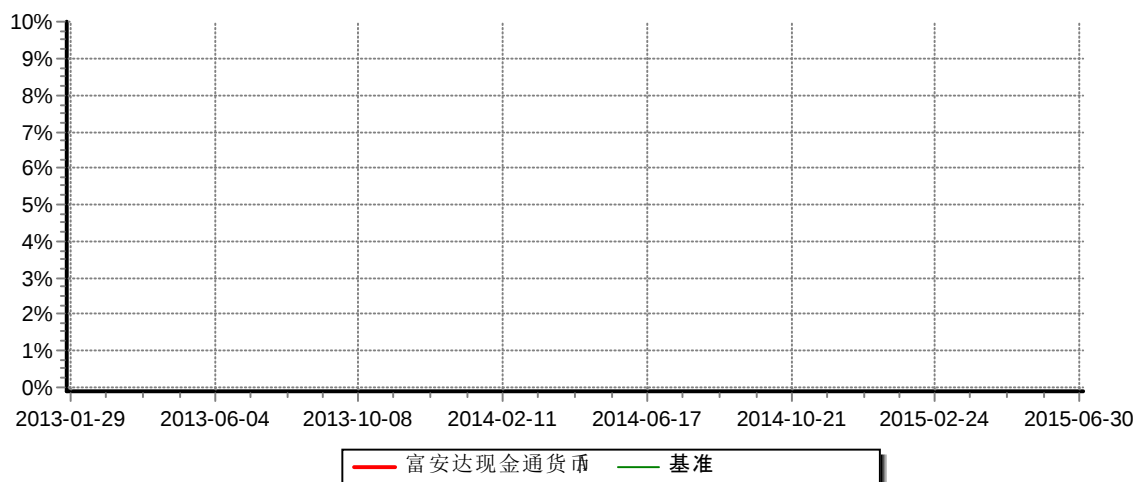
过去一年	4.2016 %	0.0142 %	0.3506 %	0.0000 %	3.8510 %	0.0142 %
自基金合同生效日起 至今（2013年01月29 日-2015年06月30日）	9.9022 %	0.0101 %	0.8503 %	0.0000 %	9.0519 %	0.0101 %

(2) 富安达现金货币B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

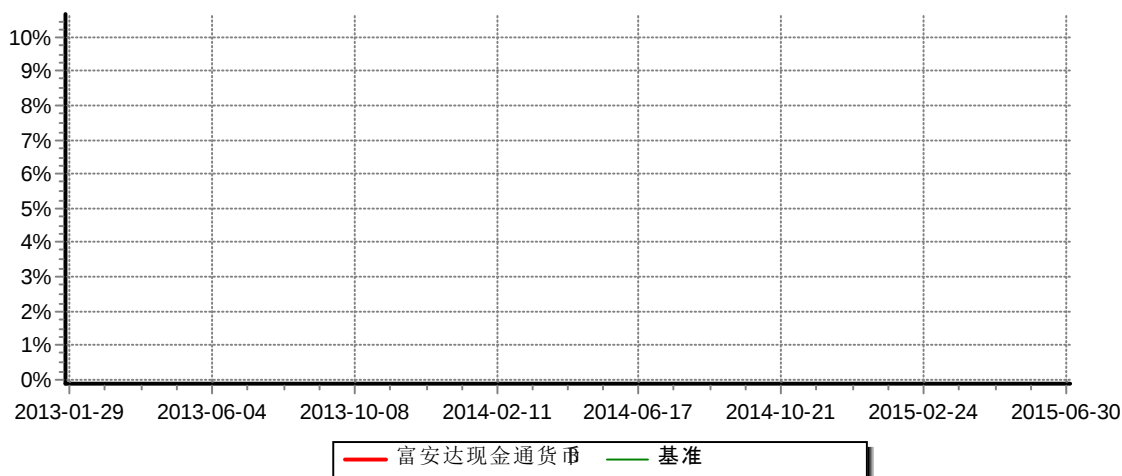
阶段(B级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2352 %	0.0013 %	0.0288 %	0.0000 %	0.2064 %	0.0013 %
过去三个月	1.0619 %	0.0155 %	0.0873 %	0.0000 %	0.9746 %	0.0155 %
过去六个月	2.1980 %	0.0137 %	0.1737 %	0.0000 %	2.0243 %	0.0137 %
过去一年	4.4519 %	0.0142 %	0.3506 %	0.0000 %	4.1013 %	0.0142 %
自基金合同生效日起 至今（2013年01月29 日-2015年06月30日）	10.5435 %	0.0101 %	0.8503 %	0.0000 %	9.6932 %	0.0101 %

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

富安达现金货币市场证券投资基金
 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1月29日-2015年6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。本报告期内，本基金因赎回而被动超标的情况已在规定时间内完成调整。



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。本报告期内，本基金因赎回而被动超标的情况已在规定时间内完成调整。

§ 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2015年6月30日，公司共管理六只开放式基金：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、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金。

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		
张凯瑜女士	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	2013年1月29日	—	7年	硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍，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。

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》、《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》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起，监察稽核部分季度对各基金公平交易执行情况进行统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日、5日和10日时间窗分析同向交易中存在价格差异的样本。通过对各投资组合间以及单个组合与组合类别间的公平交易结果分析，在特定时间窗内交易证券的溢价率和溢价金额均在正常范围内，因此不构成潜在利益输送的显著性。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内债券市场资金面宽松，回购利率和同业存款较去年明显回落，均降至历史低位。年初债券市场温和起步，资金面宽松，债券收益率缓慢下行，其中利率债领涨信用债紧随其后。二月份由于春节因素，资金面较为紧张，且春节后没有重现往年年后资金回流银行带来的流动性充裕，债券市场以一级市场利率上行为标志，进入调整步伐。春节后央行降息兑现并下调回购利率，释放价格信号，但此次降息效果较弱，市场热情明显降温，机构多选择获利兑现。二季度在货币宽松的大背景下债市进入小牛行情。央行上半年定向降准叠加降息，续作MLF、PSL等，显示货币政策仍然以定向宽松为主。大额存单正式推行，表明利率市场化再进一步。报告期内基金规模波动较大，我们主要根据规模变动情况和市场调整情况对债券资产和同存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2.0768%，富安达现金货币B份额净值收益率为2.1980%，同期业绩比较基准收益率为0.1737%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济下行压力依然较大，年中政治局会议确定了“加大定向调控力度、重视经济下行和实施积极财政政策”的基调，政治局会议以及央行的表态显示出下半年加财政稳货币的意图，重点仍是稳增长。经济复苏需要靠转型和改革，路途任重而道远。三季度债券供给增加，随着股市震荡不断加剧，配资、打新等资金短期内会选择观望或进入债市避险，资产配置需求可能向债市倾斜。在经济较弱的基本面背景下，政策放松是主旋律，我们认为三季度是较好的交易时期。下一阶段我们将严格控制组合久期，注意防范上游采掘业和部分民营企业的信用风险，坚持中高等级短久期策略，适时调整组合资产结构，获取短端滚动供给压力上升下的超额收益。

4.6 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。

本基金管理人于2015年3月27日发布《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》，自2015年3月26日起，本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除上述会计估计变更事项外，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。

4.7 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759,281.30元，B类收益分配金额为2,792,111.74元。

4.8 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合规守信情况声明

2015年上半年度，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015年上半年度，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：759,281.30元，向B级份额持有人分配利润：2,792,111.74元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2015年上半年度，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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	80,000,000.00	60,448,602.08
结算备付金		11,843,869.07	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	80,336,677.96	70,271,244.30
其中：股票投资		—	—

基金投资		—	—
债券投资		80,336,677.96	70,271,244.30
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	9,000,133.50
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	1,870,004.98	2,595,257.75
应收股利		—	—
应收申购款		18,273,464.15	28,258,138.43
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		192,324,016.16	170,573,376.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		9,999,875.00	13,649,779.52
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		285,086.54	—
应付管理人报酬		52,385.63	38,474.60
应付托管费		15,874.42	11,658.99
应付销售服务费		10,936.12	6,971.51
应付交易费用	6.4.7.7	9,860.30	11,957.29
应交税费		—	—
应付利息		516.78	1,970.05
应付利润		13,490.17	13,586.63
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	357,474.78	379,000.00

负债合计		10,745,499.74	14,113,398.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	181,578,516.42	156,459,977.47
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		181,578,516.42	156,459,977.47
负债和所有者权益总计		192,324,016.16	170,573,376.06

注：本报告截止日2015年6月30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181,578,516.42份，其中A类基金份额48,573,209.93份，B类基金份额133,005,306.49份。

6.2 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：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2015年1月1日 -2015年6月30日	上年度可比期间2014 年01月01日-2014年06 月30日
一、收入		4,140,439.04	4,255,842.79
1. 利息收入		3,364,415.57	4,181,309.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,632,258.57	2,897,914.60
债券利息收入		1,390,757.00	987,126.90
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		341,400.00	296,268.17
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		776,023.47	74,533.12
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.12	776,023.47	74,533.12
资产支持证券投资收	6.4.7.12.	—	—

益	3		
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.13	—	—
股利收益		—	—
3. 公允价值变动收益(损失以“—”号填列)		—	—
4. 汇兑收益(损失以“—”号填列)		—	—
5. 其他收入(损失以“—”号填列)		—	—
减：二、费用		589,046.00	536,664.19
1. 管理人报酬		272,925.03	255,600.13
2. 托管费		82,704.53	77,454.58
3. 销售服务费		53,594.89	50,580.68
4. 交易费用		—	—
5. 利息支出		85,165.98	57,970.21
其中：卖出回购金融资产支出		85,165.98	57,970.21
6. 其他费用	6.4.7.14	94,655.57	95,058.59
三、利润总额(亏损总额以“—”号填列)		3,551,393.04	3,719,178.60
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“—”号填列)		3,551,393.04	3,719,178.60

6.3 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：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日-2015年6月30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	156,459,977.47	—	156,459,977.47

值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	3,551,393.04	3,551,393.04
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)	25,118,538.95	—	25,118,538.95
其中：1. 基金申购款	676,512,198.43	—	676,512,198.43
2. 基金赎回款	-651,393,659.48	—	-651,393,659.48
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)	—	-3,551,393.04	-3,551,393.04
五、期末所有者权益(基金净值)	181,578,516.42	—	181,578,516.42
项 目	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30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)	324,217,147.52	—	324,217,147.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	3,719,178.60	3,719,178.60
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)	-232,239,511.11	—	-232,239,511.11
其中：1. 基金申购款	332,059,746.19	—	332,059,746.19
2. 基金赎回款	-564,299,257.30	—	-564,299,257.30
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)	—	-3,719,178.60	-3,719,178.60
五、期末所有者权益(基金净值)	91,977,636.41	—	91,977,636.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至财务报表由下列负责人签署：

蒋晓刚

朱龙芳

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

6.4 报表附注

6.4.1 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有限公司普华永道中天验字(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。

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、通知存款、短期融资券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持类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)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释、以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、

《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年半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2015年6月30日的财务状况以及2015年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

本基金管理人于2015年3月27日发布《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》，自2015年3月26日起，本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除上述会计估计变更事项外，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。

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.3 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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

2) 债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估

值；

4) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”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的绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过0.5%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

(3) 如有新增事项，按国家最新规定估值；

6.4.4.5 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.6 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、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。

6.4.4.7 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。在计算实际利率时，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因素。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本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按直线法近似计算。

6.4.4.8 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按直线法近似计算。

6.4.4.9 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至投资人基金账户。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	—
定期存款	80,000,000.00
存款期限1个月以内	50,000,000.00
存款期限3-6个月	30,000,000.00
合计	80,000,000.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年6月30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	80,336,677.96	80,711,000.00	374,322.04	0.2061%
	合计	80,336,677.96	80,711,000.00	374,322.04	0.2061%

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入反售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	640.96
应收定期存款利息	82,500.04
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1,813.84
应收债券利息	1,776,374.95
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	8,675.19
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	1,870,004.98

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	9,860.30
合计	9,860.30

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	4,089.21
预提费用	353,385.57
合计	357,474.78

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 富安达现金货币A

金额单位：人民币元

项目(A级)	本期2015年1月1日-2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	22,205,727.88	22,205,727.88
本期申购	234,794,101.59	234,794,101.59
本期赎回(以“-”号填列)	-208,426,619.54	-208,426,619.54
本期末	48,573,209.93	48,573,209.93

6.4.7.9.2 富安达现金货币B

金额单位：人民币元

项目(B级)	本期2015年1月1日-2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	134,254,249.59	134,254,249.59
本期申购	441,718,096.84	441,718,096.84

本期赎回（以“-”号填列）	-442,967,039.94	-442,967,039.94
本期末	133,005,306.49	133,005,306.49

注：本期申购中包含红利再投、转换入份额，本期赎回中包含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 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	759,281.30	—	759,281.30
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	-759,281.30	—	-759,281.30
本期末	—	—	—

6.4.7.10.2 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	2,792,111.74	—	2,792,111.74
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	-2,792,111.74	—	-2,792,111.74
本期末	—	—	—

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日
----	------------------------

活期存款利息收入	7,257.21
定期存款利息收入	1,604,041.73
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	13,612.70
其他	7,346.93
合计	1,632,258.57

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年 06月30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	776,023.47	74,533.12
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	776,023.47	74,533.12

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年 06月30日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	94,755,947.41	102,825,237.62
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	90,044,102.59	100,333,927.30
减：应收利息总额	3,935,821.35	2,416,777.20
买卖债券差价收入	776,023.47	74,533.12

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.13.0 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内不存在衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	49,590.38
汇划手续费	1,870.00
帐户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	94,655.57

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内，关联方关系未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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 ")	基金管理人的控股股东、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日	上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	272,925.03	255,600.13
其中：应支付销售机构	39,382.83	73,725.89

的客户维护费		
--------	--	--

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日	上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	82,704.53	77,454.58

注：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。

6.4.10.2.3 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 2015年1月1日-2015年6月30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	10,877.55	4,951.08	15,828.63
交通银行股份有限公司	12,286.20	86.15	12,372.35
南京证券股份有限公司	5,045.27	134.11	5,179.38
合计	28,209.02	5,171.34	33,380.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达现金货币	富安达现金货币	合计

	A	B	
富安达基金管理有限 公司	4,147.11	1,347.13	5,494.24
交通银行股份有限公 司	28,406.11	1,671.98	30,078.09
南京证券股份有限公 司	2,584.31	1,814.17	4,398.48
合计	35,137.53	4,833.28	39,970.81

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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2015年1月1日-2015年6月30日		上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30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	—	11,115,185.06	—	16,393,956.14
期间申购/买入总份额	—	85,480,742.46	—	9,470,493.13
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总 份额	—	-45,000,000.00	—	-12,000,000.00
期末持有的基金份额	—	51,595,927.52	—	13,864,449.27
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	38.79%	—	19.58%

注：本报告期内基金管理人运用固有资金未持有富安达现金货币A，仅持有富安达现金货币B。

6.4.10.4.2 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：份

关联方名称		本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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
A类	富安达资产管理（上海）有限公司	4007339.26	8.25%		—
A类	富安达-交通银行-先锋1号资产管理计划	3757206.78	7.74%	0	—
B类	富安达-交通银行-先锋2号资产管理计划	6550688.5	4.93%	0	—
B类	富安达基金动态对冲分级1号资产管理计划	30000000	22.56%	0	—
B类	南京证券股份有限公司	20258068.16	11.74%	33193050.56	21.22%
B类	富安达资产管理（上海）有限公司	0	—	21252796.76	13.58%

注：报告期末仅管理人主要股东南京证券、富安达-交通银行-先锋2号资产管理计划、富安达基金动态对冲分级1号资产管理计划持有富安达现金货币B，富安达-交通银行-先锋1号资产管理计划、富安达资产管理（上海）有限公司持有富安达现金货币A；基金托管人及管理人其余股东及控制机构均未持有本基金。

6.4.10.5 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2015年1月1日-2015年6月30日		上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日	
	期末余额	当期存款利息收入	期末余额	当期存款利息收入
交通银行活期存款	—	7,257.21	589,373.66	19,740.15
交通银行定期存款	—	—	—	106,400.00

注：注：1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2、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2015年6月30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。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金(A级)	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
757,752.44	—	1,528.86	759,281.30	
已按再投资形式转实收基金(B级)	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
2,793,737.06	—	-1,625.32	2,792,111.74	

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
041460119	14沪北高新CP002	2015-07-01	100.87	100,000.00	10,086,507.89
合计				100,000.00	10,086,507.89

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险控制委员会（董事会层面）、督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

本基金是货币型证券投资基金，基金管理人根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过定性和定量相结合的方法，识别基金相关信用风险、流动性风险及市场风险等，通过风险控制，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 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建立了较完善的信用风险管理流程，在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估，并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，以及通过分散化投资以分散风险。

6.4.13.2.1 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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	80,336,677.96	60,270,325.65
A-1以下	—	—
未评级	—	10,000,918.65
合计	80,336,677.96	70,271,244.30

注：未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金对资金需求不能足额支付的风险。本基金的流动性风险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出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人持续进行本基金的流动性需求分析，构建投资组合时，对备选投资品种进行流动性检验，并以适度分散策略保持组合流动性，严格控制缺乏流动性资产的比例。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的基金资产损失的可能性，包括利率风险、外汇风险等，本基金管理人通过监测组合久期等指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2015 年6月30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	50,000, 000.00		30,000, 000.00				80,000, 000.00

结算备付金	11,843,869.07	—	—	—	—	—	11,843,869.07
交易性金融资产	—	10,013,676.11	70,323,001.85	—	—	—	80,336,677.96
应收利息	—	—	—	—	—	1,870,004.98	1,870,004.98
应收申购款	5,000.00	—	—	—	—	18,268,464.15	18,273,464.15
资产总计	61,848,869.07	10,013,676.11	100,323,001.85	—	—	20,138,469.13	192,324,016.16
负债							
卖出回购金融资产款	9,999,875.00	—	—	—	—	—	9,999,875.00
应付赎回款	—	—	—	—	—	285,086.54	285,086.54
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	52,385.63	52,385.63
应付托管费	—	—	—	—	—	15,874.42	15,874.42
应付销售服务费	—	—	—	—	—	10,936.12	10,936.12
应付交易费用	—	—	—	—	—	9,860.30	9,860.30
应付利息	—	—	—	—	—	516.78	516.78
应付利润	—	—	—	—	—	13,490.17	13,490.17
其他负债	—	—	—	—	—	357,474.78	357,474.78
负债总计	9,999,875.00	—	—	—	—	745,624.74	10,745,499.74
利率敏感度缺口	51,848,994.07	10,013,676.11	100,323,001.85	—	—	19,392,844.39	181,578,516.42

上年度末 2014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	448,602 .08	60,000, 000.00	—	—	—	—	60,448, 602.08
交易性金融 资产	10,000, 918.65	30,078, 795.35	30,191, 530.30	—	—	—	70,271, 244.30
买入返售金 融资产	9,000,1 33.50	—	—	—	—	—	9,000,1 33.50
应收利息	—	—	—	—	—	2,595,2 57.75	2,595,2 57.75
应收申购款	27,400, 000.00	—	—	—	—	858,138 .43	28,258, 138.43
资产总计	46,849, 654.23	90,078, 795.35	30,191, 530.30	—	—	3,453,3 96.18	170,573 ,376.06
负债							
卖出回购金 融资产款	13,649, 779.52	—	—	—	—	—	13,649, 779.52
应付管理人 报酬	—	—	—	—	—	38,474. 60	38,474. 60
应付托管费	—	—	—	—	—	11,658. 99	11,658. 99
应付销售服 务费	—	—	—	—	—	6,971.5 1	6,971.5 1
应付交易费 用	—	—	—	—	—	11,957. 29	11,957. 29
应付利息	—	—	—	—	—	1,970.0 5	1,970.0 5
应付利润	—	—	—	—	—	13,586. 63	13,586. 63
其他负债	—	—	—	—	—	379,000	379,000

						. 00	. 00
负债总计	13, 649, 779. 52	—	—	—	—	463, 619 . 07	14, 113, 398. 59
利率敏感度缺口	33, 199, 874. 71	90, 078, 795. 35	30, 191, 530. 30	—	—	2, 989, 777. 11	156, 459 , 977. 47

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	25bp	-95, 822. 22	-22, 918. 58
	-25bp	95, 463. 04	22, 952. 00

注：本报告期末及上年度末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降25个基点，对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资	—	—	—	—

产-股票投资				
交易性金融资产-债券投资	80,711,000.00	44.45	70,462,000.00	45.04
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	80,711,000.00	44.45	70,462,000.00	45.04

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

截至报告期末，本基金未持有交易性权益类投资，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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 投资组合报告

7.1 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	80,336,677.96	41.77
	其中：债券	80,336,677.96	41.77
	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	91,843,869.07	47.75
4	其他各项资产	20,143,469.13	10.47
5	合计	192,324,016.16	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。

7.2 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	4.36	
	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	9,999,875.00	5.51
	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

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。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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180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。

7.3.2 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	34.06	5.51
	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	5.51	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—180天	38.68	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天(含)	16.57	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		94.82	5.51

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。

7.4 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	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	80,336,677.96	44.24
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	80,336,677.96	44.24
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

7.5 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	摊余成本	占基金资产净
----	------	------	------	------	--------

	码		(张)		值 比例(%)
1	041469061	14中丝CP001	100,000	10,131,497.32	5.58
2	041460119	14沪北高新CP002	100,000	10,086,507.89	5.55
3	041562021	15金港CP001	100,000	10,042,397.38	5.53
4	041572002	15镇旅发CP001	100,000	10,036,230.18	5.53
5	041473007	14天富CP001	100,000	10,013,676.11	5.51
6	041560006	15昌源水务CP001	100,000	10,012,330.45	5.51
7	041476002	14新海连CP001	100,000	10,007,660.54	5.51
8	041460106	14海沧投资CP002	100,000	10,006,378.09	5.51

7.6 “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	43
报告期内偏离度的最高值	0.4590%
报告期内偏离度的最低值	0.1013%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2401%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 报告期内，本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

7.8.3 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。

7.8.4 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	1,870,004.98
4	应收申购款	18,273,464.15
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	20,143,469.13

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	1,049	46,304.30	7,866,725. 72	16.20%	40,706,484 .21	83.80%

货币A						
富安达 现金通 货币B	8	16,625,663 .31	119,404,79 6.99	89.77%	13,600,509 .50	10.23%
合计	1,057	171,786.68	127,271,52 2.71	70.09%	54,306,993 .71	29.91%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人 员持有本基金	富安达现金 货币A	248,776.34	0.51%
	富安达现金 货币B	—	—
	合计	248,776.34	0.14%

8.3 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0-10万份（含）。

§9 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
--	----------	----------

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	22,205,727.88	134,254,249.59
本报告期基金总申购份额	234,794,101.59	441,718,096.84
减：本报告期基金总赎回份额	208,426,619.54	442,967,039.94
本报告期期末基金份额总额	48,573,209.93	133,005,306.49

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入机分级份额调增份额；总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

经富安达基金管理有限公司第二届董事会第一次会议审议通过，同意督察长陈宁同志因已届法定退休年龄辞去督察长职务，提名张丽珉同志为公司督察长。本基金管理人已于2015年3月4日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了富安达基金管理有限公司高级管理人变更的公告。督察长变更事项已向中国证券监督管理委员会和上海监管局报告，经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]297号文核准批复。

经富安达基金管理有限公司总经理办公会（2015）13号决议通过，增聘毛矛为富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。本基金管理人已于2015年5月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告。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。

经富安达基金管理有限公司总经理办公会（2015）13号决议通过，增聘孙绍冰为富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。本基金管理人已于2015年5月23日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告。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。

经富安达基金管理有限公司总经理办公会（2015）14号决议通过，免去黄强富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理职务。本基金管理人已于2015年8月12

日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告。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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为审计师。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内，本基金管理人未受到任何处罚。

本报告期内，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。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券成交金额	债券交易占当期成交总额的比例	债券回购成交金额	债券回购交易占当期成交总额的比例	权证交易成交金额	权证交易占当期成交总额的比例	应支付券商的佣金	应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例	备注
------	--------	--------	----------------	----------	------------------	----------	----------------	----------	--------------------	----

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

（一）财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生；

（二）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（三）能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他信息咨询服务；

（四）能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

（五）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交

易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；能够提供很好的交易执行。

②券商专用交易单元选择程序：

（一）券商席位由投资管理部与研究发展部业务人员推荐，经投资管理部、研究发展部门会议讨论，形成重点评估的券商备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

（二）投资管理部、研究发展部全体业务人员遵照券商选择标准的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成券商排名及专用席位租用意见，报公司总经理批准。

（三）公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议，明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

（四）若签约券商的服务不能满足要求，或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚，公司可以提前终止签署的协议，并撤销租用的席位。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%（含）的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富安达基金管理有限公司2014年12月31日基金净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-01-01
2	关于增加上海联泰资产管理有限公司等为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-01-21
3	富安达现金货币市场证券投资基金2014年第4季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-01-21
4	富安达现金货币市场证券投资基金2015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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-02-12
5	富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书(更新)（二〇一五年第一号）摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-03-14

6	富安达现金货币市场证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一五年第一号)	公司网站	2015-03-14
7	富安达现金货币市场证券投资基金2014年年度报告	公司网站	2015-03-28
8	富安达现金货币市场证券投资基金2014年年度报告(摘要)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-03-28
9	富安达现金货币市场证券投资基金2015年第1季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-04-20
10	富安达现金货币市场证券投资基金2015年五一假期前暂停申购(含定投及转换转入)业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-04-24
11	富安达基金管理有限公司关于开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-06-10
12	关于增加上海汇付金融服务有限公司为富安达基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-06-12
13	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与上海汇付金融服务有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-06-16
14	富安达基金管理有限公司关于调整富安达现金货币市场证券投资基金最低申购金额、最低赎回份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-06-18
15	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网上银行、手机银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站	2015-06-26

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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
《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》
《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》
基金管理人业务资格批件和营业执照
基金托管人业务资格批件和营业执照
报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告
中国证监会要求的其他文件

11.2 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。

11.3 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

二〇一五年八月二十七日