

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2014年年度报告摘要

2014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：2015年3月28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2015年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。本报告期自2014年09月11日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	富安达新兴成长混合
基金主代码	000755
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月11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	104,679,160.39
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过股票与债券等资产的合理配置，通过深入研究并积极投资于新兴产业及其相关行业中的高速增长企业，分享新兴产业发展所带来的投资机会，在有效控制风险的前提下，力争为投资者带来长期的超额收益。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型，辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。一般情况下，本基金将大部分基金资产投资于新兴产业及其相关行业中成长型上市公司所发行的股票等证券，当证券市场系统性风险加大时，本基金将降低相关证券资产的配置比例。

业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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
	联系电话	021-61870999
	电子邮箱	service@fadfunds.com
客户服务电话	400-630-6999（免长途） 021-61870666	95559
传真	021-61870888	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2014年9月11日-2014年12月31日
本期已实现收益	-3,497,051.04
本期利润	-317,614.04
加权平均基金份额本期利润	-0.0016

本期加权平均净值利润率	-0.16%
本期基金份额净值增长率	-5.10%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配利润	-5,334,081.13
期末可供分配基金份额利润	-0.0510
期末基金资产净值	99,345,079.26
期末基金份额净值	0.9490
3.1.3 累计期末指标	2014年末
基金份额累计净值增长率	-5.10%

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，例如：基金的认购、申购、赎回费等，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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-5.22%	1.98%	6.11%	0.82%	-11.33%	1.16%
自基金合同生效日起至今（2014年09月11日-2014年12月31日）	-5.10%	1.79%	8.51%	0.82%	-13.61%	0.97%

注：①本基金业绩比较基准为：60%×中证新兴产业指数+40%×中债总指数，

②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

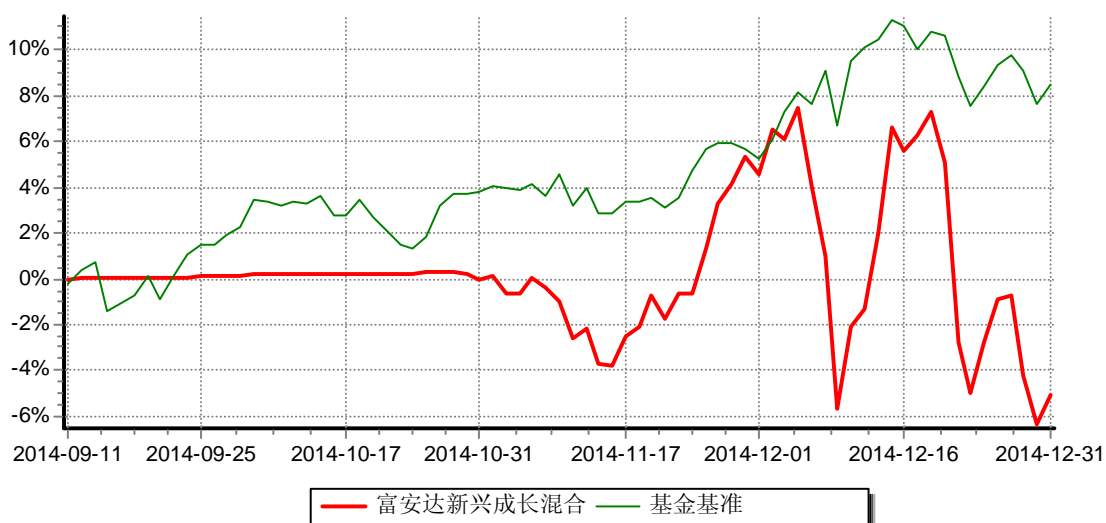
$$\text{Return } t = 60\% \times [\text{中证新兴产业指数}_t / \text{中证新兴产业指数}_{(t-1)} - 1] + 40\% \times [\text{中债总指数}_t / \text{中债总指数}_{(t-1)} - 1]$$

$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times \text{Benchmark } (t-1)$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

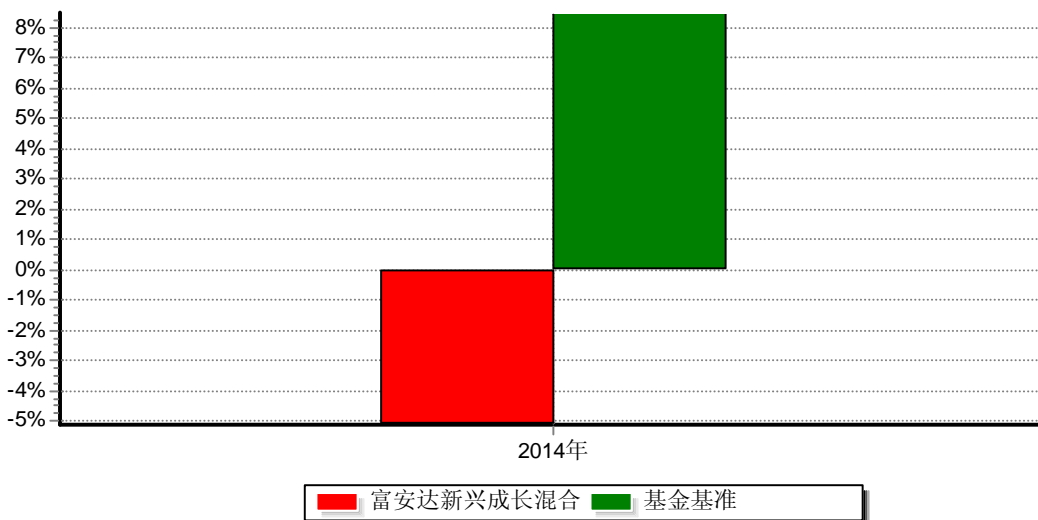
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较



注：本基金于2014年9月11日成立，截至本报告期末，本基金成立不满一年。本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2015年3月10日。截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

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：本基金合同于2014年9月11日生效，合同生效当年按实际存续期计算，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

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§ 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2014年12月31日，公司共管理六只开放式基金：富安达优势成长股票型证券投资基金、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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔学兵	本基金的基金经理、富安达优势成长股票型证券投资基金基金经理、公司投资管理部副总监、富安达基金管理有限公司董事	2014年9月11日	—	19年	历任南京证券股份有限公司证券投资总部投资经理；资产管理总部投资主办，硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍

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》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达策略精选混合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 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》。

从管理人旗下第二个投资组合成立之日起，监察稽核部定期对各基金公平交易执行情况进行了统计分析，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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年以来, 尽管宏观经济层面依然乏善可陈, 但受益于经济结构调整的不断推进、改革红利的不断释放以及货币政策的持续宽松, 投资者信心大幅回升, 中国资本市场活力迸发, 上证综指冲至3200点之上。

以11月末降息为标志, A股市场发生了深刻的变化, 大规模的增量资金快速入市, 扰动了存量市场原有生态, 传统周期领域的价值重估一度秒杀新兴成长领域的选美运动, 市场风格极致分化, 成长板块经历估值洗礼。

本基金重点配置的信息技术类个股, 在12月末最后九个交易日中经历了泥沙俱下式的快速下跌, 导致基金在年末遭受了残酷的净值回撤, 尽管我们采取了减仓、调结构等措施予以一定对冲, 但在市场极致风格冲击下, 净值依然受损严重。鉴于对四季度杠杆驱动下指数化行情的高度与力度估计不足, 未能在基金开放后赎回压力较大情况下, 更好地控制建仓节奏, 我们对此也深表遗憾, 但我们不会因此而改变本基金的投资风格, 不会因此而动摇对真正受益于经济结构调整与社会变迁进程的优质成长股的长期坚守。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日, 本基金份额净值为0.9490元, 本报告期份额净值增长率为-5.10%, 同期业绩比较基准收益率为8.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

低增长背景下经济波幅收敛, 无风险利率下行引发的风险偏好提升成为驱动市场的主导力量。“一路一带”的走出去和“国企改革”的内部优化, 有助于市场对中国经济的预期从硬着陆转变为软着陆, 在此背景下, 经济增长的短期波动以及行业景气度等业绩因素都会被淡化, 在居民资产配置调整浪潮推动下, 传统周期蓝筹的估值修复仍有一定空间, 而新兴成长领域受益于经济结构调整与社会变迁进程, 更将迸发出巨大的活力。只要上述逻辑不被破坏, 市场中长期乐观是可以期待的。

在上述框架下展望2015, 新常态下机遇与挑战同样显著, 市场活力显著增强的同时, 行业内部加速分化、投资者结构多元化、博弈更趋立体化、主题投资极致化。短中期判断上, 传统周期蓝筹的估值修复基本告一段落, 进一步的估值提升需要宏观层面的经济企稳与微观层面的产能出清配合, 现阶段依然看不到。在经济结构调整的大背景下, 转型是最宏大、最长期、最确定的基本面, 能够主导未来的, 依然属于新兴成长领域。2014年周期与成长风格的估值收敛应该是短周期的均值回归, 不应是长周期的逆转颠覆, 经历估值洗礼后被错杀的优质成长股2015年将呈现出更大的比较优势。

具体到2015年的投资重心, 我们重点关注互联网对传统产业的渗透与改造, 以及对人们生活方式的影响与改变。行业的互联网化、服务的云化以及大数据的广泛应用, 都

会促成新的商业模式进而带来公司估值的大幅提升。互联网金融、互联网医疗、信息安全、文教体育、农业信息化等成长领域具备低渗透率、高增长空间的成长因子，其中蕴含丰富的投资机会。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期未进行收益分配。

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遵规守信情况声明

2014年度，基金托管人在富安达新兴成长灵活配置混合型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

2014年度，富安达基金管理有限公司在富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基

金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2014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新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2014年12月31日的资产负债表、2014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。注册会计师单峰、沈兆杰于2015年3月27日签字出具了普华永道中天审字(2015)第20762号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	1,512,299.29
结算备付金		18,141,292.42
存出保证金		54,579.64
交易性金融资产	7.4.7.2	83,778,508.97
其中：股票投资		83,778,508.97
基金投资		
债券投资		—

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	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	3,265.27
应收股利		—
应收申购款		273,649.06
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		103,763,594.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		3,321,606.32
应付赎回款		273,543.27
应付管理人报酬		155,164.34
应付托管费		25,860.73
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	401,933.77
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	240,406.96
负债合计		4,418,515.39

所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	104,679,160.39
未分配利润	7.4.7.10	-5,334,081.13
所有者权益合计		99,345,079.26
负债和所有者权益总计		103,763,594.65

注：1、报告截止日2014年12月31日，基金份额净值0.9490元，基金份额总额104,679,160.39份。

2、本基金于2014年9月11日生效，本财务报表的实际编制期间为2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日。无上年度可比期间，下同。

7.2 利润表

会计主体：富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年9月11日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年9月11日至2014年12月31日
一、收入		1,634,715.54
1. 利息收入		1,576,669.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,251,074.37
债券利息收入		—
资产支持证券利息收 入		—
买入返售金融资产收 入		325,594.96
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		-3,662,883.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,662,883.13
基金投资收益		
债券投资收益	7.4.7.13	—
7.4.7.14	7.4.7.13. 2	—
贵金属投资收益		—

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	3,179,437.00
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	541,492.34
减：二、费用		1,952,329.58
1. 管理人报酬		925,636.40
2. 托管费		154,272.75
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.19	631,090.43
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	7.4.7.20	241,330.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-317,614.04
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-317,614.04

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014年9月11日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2014年9月11日至2014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)	—	—	—
二、本期经营活动产生的基金	—	-317,614.04	-317,614.04

净值变动数(本期利润)			
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)	-144,743,167.79	-5,016,467.09	-149,759,634.88
其中：1. 基金申购款	8,071,613.73	37,389.16	8,109,002.89
2. 基金赎回款	-152,814,781.52	-5,053,856.25	-157,868,637.77
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)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	104,679,160.39	-5,334,081.13	99,345,079.26

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

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金(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[2014]第697号《关于核准富安达新兴成长灵活配置混合型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《富安达新兴成长灵活配置混合型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的净认购资金为249,339,317.51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(2014)第492号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2014年9月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为249,422,328.18份基金份额,其中认购资金利息折合83,010.67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《富安达新兴成长灵活配置混合型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

括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票）、债券（包括国债、央票、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。股票资产占基金资产的比例为0%-95%；本基金非现金资产中不低于80%的资产将投资于新兴产业及其相关行业中成长型上市公司的股票；债券资产占基金资产的比例为0%-95%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证以及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准：中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。

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、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会于2010年2月8日发布的《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〉》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日止期间的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2014年12月31日的财务状况以及2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列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。

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和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明

外，均以人民币元为单位表示。

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。

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。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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,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。当本基金依法有权抵销债权债务且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在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后

的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红权益再投资日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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股票投资和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：

1、对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

3、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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

3、对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。其中，对基金从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额。

4、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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	
	2014年12月31日	
活期存款	1,512,299.29	
定期存款	—	
其中：存款期限1-3个月	—	
其他存款	—	
合计	1,512,299.29	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	80,599,071.97	83,778,508.97	3,179,437.00
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	80,599,071.97	83,778,508.97	3,179,437.00

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应收活期存款利息	661.10
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	2,579.51
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.06
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	24.60
合计	3,265.27

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	401,933.77
银行间市场应付交易费用	—
合计	401,933.77

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	—

应付赎回费	406.96
预提费用	240,000.00
合计	240,406.96

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	249,422,328.18	249,422,328.18
本期申购	8,071,613.73	8,071,613.73
本期赎回（以“-”号填列）	-152,814,781.52	-152,814,781.52
本期末	104,679,160.39	104,679,160.39

注：1. 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

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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	-3,497,051.04	3,179,437.00	-317,614.04
本期基金份额交易产生的变动数	-888,666.81	-4,127,800.28	-5,016,467.09
其中：基金申购款	55,412.05	-18,022.89	37,389.16
基金赎回款	-944,078.86	-4,109,777.39	-5,053,856.25
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-4,385,717.85	-948,363.28	-5,334,081.13

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月11日至2014年12月31日
活期存款利息收入	24,909.32

定期存款利息收入	1,068,166.67
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	157,887.54
其他	110.84
合计	1,251,074.37

注：本基金合同于2014年9月11日生效，本期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.12 股票投资收益

注：本基金合同于2014年9月11日生效，本期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

单位：人民币元

项目	本期
	2014年9月11日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	178,614,354.77
减：卖出股票成本总额	182,277,237.90
买卖股票差价收入	-3,662,883.13

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.2 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。

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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未获得衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	3,179,437.00
——股票投资	3,179,437.00
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	3,179,437.00

注：本基金合同于2014年9月11日生效，本期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日至2014年12月31日
基金赎回费收入	541,492.34
合计	541,492.34

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金合同于2014年9月11日生效，本期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	631,090.43
银行间市场交易费用	—

合计	631,090.43
----	------------

注：本基金合同于2014年9月11日生效，本期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日至2014年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	180,000.00
汇划手续费	430.00
其他	900.00
合计	241,330.00

注：本基金合同于2014年9月11日生效，本期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.8 关联方关系

7.4.8.1 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。

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。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年9月11日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
南京证券股份 有限公司	148,536,108.62	33.64%

注：本基金合同于2014年9月11日生效，本期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.9.1.2 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。

7.4.9.1.3 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。

7.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	402,348.83

注：1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 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基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

3、本基金合同于2014年9月11日生效，上期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年9月11日至2014年12月31日	
	当期发生的基金应支付的托管费	154,272.75

注：1. 支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2、本基金合同于2014年9月11日生效，上期数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.9.3 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（回购）交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.9.4.2 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 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
南京证券	1,800,000.00	1.71%

7.4.9.5 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 2014年9月11日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入

交通银行	1,512,299.29	24,909.32
------	--------------	-----------

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2014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。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金2014年9月11日（基金合同生效日）至2014年12月31日期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额
002439	启明星辰	2014-12-08	重大事项	23.84	2015-03-12	28.86	420,000	9,421,413.62	10,012,800.00
300168	万达信息	2014-12-31	重大事项	46.20	2015-01-08	44.50	202,000	6,203,779.79	9,332,400.00

注：无

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10.3.2 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交易中作为抵押的债券。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	权益投资	83,778,508.97	80.74
	其中：股票	83,778,508.97	80.74
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	19,653,591.71	18.94
7	其他各项资产	331,493.97	0.32
8	合计	103,763,594.65	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	17,672,400.00	17.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	7,428,464.68	7.48

F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,195,658.29	38.45
J	金融业	8,785,320.00	8.84
K	房地产业	8,931,434.00	8.99
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	2,765,232.00	2.78
	合计	83,778,508.97	84.33

8.3 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投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002439	启明星辰	420,000	10,012,800.00	10.08
2	300168	万达信息	202,000	9,332,400.00	9.39
3	600048	保利地产	450,100	4,870,082.00	4.90
4	600410	华胜天成	218,677	4,454,450.49	4.48
5	002491	通鼎光电	200,000	4,100,000.00	4.13
6	300010	立思辰	189,525	3,976,234.50	4.00
7	000547	闽福发 A	280,000	3,757,600.00	3.78
8	600571	信雅达	136,910	3,686,986.30	3.71
9	000157	中联重科	417,700	2,948,962.00	2.97
10	600895	张江高科	207,600	2,765,232.00	2.78

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富安达基金管理

有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002439	启明星辰	12,718,212.99	12.80
2	300168	万达信息	10,236,236.65	10.30
3	002649	博彦科技	9,003,867.81	9.06
4	000555	神州信息	8,364,611.58	8.42
5	300075	数字政通	8,011,129.98	8.06
6	300347	泰格医药	7,656,325.46	7.71
7	300047	天源迪科	7,430,637.82	7.48
8	300334	津膜科技	6,960,169.32	7.01
9	300379	东方通	6,933,313.85	6.98
10	300206	理邦仪器	6,805,172.00	6.85
11	600410	华胜天成	6,789,949.00	6.83
12	300027	华谊兄弟	6,520,707.00	6.56
13	300275	梅安森	6,450,636.66	6.49
14	300290	荣科科技	5,794,897.00	5.83
15	000021	深科技	5,703,200.00	5.74
16	300188	美亚柏科	5,550,041.43	5.59
17	300045	华力创通	5,295,812.92	5.33
18	300329	海伦钢琴	5,196,843.00	5.23
19	300010	立思辰	5,135,503.95	5.17
20	300287	飞利信	5,007,632.00	5.04
21	300074	华平股份	4,995,164.00	5.03
22	600212	江泉实业	4,537,723.00	4.57
23	000547	闽福发 A	4,442,005.00	4.47
24	002491	通鼎光电	4,428,306.40	4.46

25	002153	石基信息	4,361,080.76	4.39
26	300113	顺网科技	4,278,516.00	4.31
27	300231	银信科技	4,041,145.00	4.07
28	600048	保利地产	4,024,359.54	4.05
29	600571	信雅达	3,656,079.00	3.68
30	002583	海能达	3,617,853.00	3.64
31	002609	捷顺科技	3,591,881.00	3.62
32	000938	紫光股份	3,290,884.22	3.31
33	600502	安徽水利	3,281,680.00	3.30
34	603308	应流股份	3,234,182.04	3.26
35	002065	东华软件	3,084,154.39	3.10
36	300162	雷曼光电	3,044,120.00	3.06
37	000002	万 科 A	3,030,946.00	3.05
38	002432	九安医疗	3,022,507.30	3.04
39	002280	新世纪	2,977,834.57	3.00
40	000157	中联重科	2,972,630.00	2.99
41	600158	中体产业	2,896,781.00	2.92
42	600895	张江高科	2,745,186.64	2.76
43	002051	中工国际	2,383,253.57	2.40
44	600820	隧道股份	2,236,608.00	2.25
45	600588	用友软件	2,135,771.21	2.15
46	300396	迪瑞医疗	2,130,286.76	2.14
47	002130	沃尔核材	2,082,320.00	2.10
48	600284	浦东建设	2,075,134.92	2.09
49	601788	光大证券	2,026,883.00	2.04
50	600720	祁连山	1,994,583.00	2.01

注：1、“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净
----	------	------	----------	----------

				值比例 (%)
1	002649	博彦科技	9,067,295.44	9.13
2	000555	神州信息	8,561,260.92	8.62
3	300075	数字政通	8,272,917.33	8.33
4	300379	东方通	7,662,407.36	7.71
5	300047	天源迪科	7,071,400.07	7.12
6	300347	泰格医药	6,728,690.68	6.77
7	300334	津膜科技	6,354,392.17	6.40
8	300168	万达信息	5,829,094.00	5.87
9	300027	华谊兄弟	5,708,779.45	5.75
10	300206	理邦仪器	5,704,575.61	5.74
11	000021	深科技	5,666,981.93	5.70
12	300290	荣科科技	5,495,386.01	5.53
13	300275	梅安森	5,232,536.30	5.27
14	300287	飞利信	4,886,171.46	4.92
15	300045	华力创通	4,818,164.77	4.85
16	300231	银信科技	4,747,726.30	4.78
17	300188	美亚柏科	4,591,199.42	4.62
18	300074	华平股份	4,512,710.79	4.54
19	300162	雷曼光电	4,455,533.00	4.48
20	002439	启明星辰	3,959,451.07	3.99
21	600212	江泉实业	3,929,548.93	3.96
22	300113	顺网科技	3,910,078.79	3.94
23	300329	海伦钢琴	3,717,121.06	3.74
24	002609	捷顺科技	3,537,527.03	3.56
25	002583	海能达	3,340,616.76	3.36
26	603308	应流股份	3,292,545.92	3.31
27	002432	九安医疗	3,261,209.99	3.28
28	000938	紫光股份	3,253,578.84	3.28
29	600158	中体产业	3,215,475.00	3.24
30	002065	东华软件	2,875,474.20	2.89

31	002130	沃尔核材	2,028,916.00	2.04
----	--------	------	--------------	------

注：1、“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	262,876,309.87
卖出股票的收入（成交）总额	178,614,354.77

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	54,579.64
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,265.27
5	应收申购款	273,649.06
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	331,493.97

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002439	启明星辰	10,012,800.00	10.08	重大事项
2	300168	万达信息	9,332,400.00	9.39	重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

§ 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

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
1,100	95,162.87	2,790,119.01	2.67%	101,889,041.38	97.33%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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基金	51,356.41	0.05%

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。

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年9月11日)基金份额总额	249,422,328.18
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,071,613.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	152,814,781.52
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	104,679,160.39

§ 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：

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2014年4月3日在公司召开职工大会，经与会职工民主投票，同意孔学兵同志为富安达基金管理有限公司第二届职工董事。

经富安达基金管理有限公司第一届董事会第十七次会议审议通过，同意董事长张华东同志因已届法定退休年龄辞去董事长（法定代表人）职务，聘任秦雁同志为公司董事会董事长（法定代表人）。本基金管理人已于2014年4月17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。总经理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[2014]412号文核准批复。

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。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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

本基金本报告期支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为60,000元人民币。

截至本报告期末，该事务所已向本基金提供1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本报告期内未受到任何稽查或处罚。

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 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	11,572,606.04	2.62%	10,535.39	2.62%	
国金证券	1	61,179,141.02	13.86%	55,697.86	13.86%	
国泰君安	1	23,814,852.21	5.39%	21,680.98	5.39%	
南京证券	1	148,536,108.62	33.64%	135,227.31	33.64%	
中金公司	1	32,684,406.54	7.40%	29,756.17	7.40%	
中信证券	2	163,703,550.21	37.08%	149,036.06	37.08%	
申银万国	2		—	—	—	
广发证券	2		—	—	—	
兴业证券	2		—	—	—	
招商证券	2		—	—	—	
华泰证券	1		—	—	—	
银河证券	1		—	—	—	
东方证券	2		—	—	—	
海通证券	1		—	—	—	

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。

③在上述租用的券商交易单元中, 全部为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
光大证券	—	—	764,300,000.00	81.02%	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
南京证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	179,000,000.00	18.98%	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—

兴业证券		—		—		—
招商证券		—		—		—
华泰证券		—		—		—
银河证券		—		—		—
东方证券		—		—		—
海通证券		—		—		—

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。

③在上述租用的券商交易单元中，全部为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

富安达基金管理有限公司

二〇一五年三月二十八日