富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金
2016年半年度报告摘要

2016年06月30日

基金管理人：富安达基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016年08月26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。

基金托管人农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富安达信用纯债债券发起式	
基金主代码	000284	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年10月25日	
基金管理人	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,438,913.69	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达信用主题A	富安达信用主题C
下属分级基金的基金代码	000284	000285
报告期末下属分级基金的份额总额	11,853,792.98	1,585,120.71

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，在追求控制信用风险和保持基金资产流动性的基础上，力争获得超越比较基准的投资收益，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	信用债券是本基金投资的核心主题，信用债券策略是本基金债券投资的核心策略。本基金将基于对整体收益率与信用利差的判断以及对发行人和发行条款的深入研究精选个券，确定具体信用债券的配置。本基金主要从宏观经济周期的角度出发，基于对宏观经济周期、收益率曲线和信用利差的判断，分析并筛选出特定经济阶段下具有相对优势的期限与信用等级的债券进行配置。本基金将利用目前的交易所和银行间两个投资市场的利差不同，密切关注两市场之间的利差波动情况，在两市场之间轮动切换，积极寻找跨市场中现券和回购操作的套利机会。
业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收

	益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘涛	林葛
	联系电话	021-61870999	010-66060069
	电子邮箱	service@fadfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-630-6999（免长途） 021-61870666	95599
传真		021-61870888	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§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

单位：人民币元

	报告期（2016年01月01日-2016年06月30日）	
3.1.1 期间数据和指标	富安达信用主题A	富安达信用主题C
本期已实现收益	-2,120,768.78	-328,867.98
本期利润	-2,518,259.52	-388,696.55
加权平均基金份额本期利润	-0.2091	-0.2143
本期基金份额净值增长率	-15.66%	-15.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1156	0.1027

期末基金资产净值	13,224,040.06	1,747,970.30
期末基金份额净值	1.1156	1.1027

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 (富安达信用主题A)	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
过去一个月	0.38%	0.34%	0.74%	0.04%	-0.36%	0.30%
过去三个月	-5.35%	0.57%	0.24%	0.08%	-5.59%	0.49%
过去六个月	-15.66%	0.94%	1.35%	0.09%	-17.01%	0.85%
过去一年	-24.23%	0.95%	6.71%	0.09%	-30.94%	0.86%
自基金合同生效日起至今（2013年10月25日-2016年06月30日）	11.56%	0.89%	19.65%	0.13%	-8.09%	0.76%
阶段 (富安达信用主题C)	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
过去一个月	0.34%	0.34%	0.74%	0.04%	-0.40%	0.30%
过去三个月	-5.45%	0.57%	0.24%	0.08%	-5.69%	0.49%
过去六个月	-15.83%	0.94%	1.35%	0.09%	-17.18%	0.85%
过去一年	-24.52%	0.95%	6.71%	0.09%	-31.23%	0.86%
自基金合同生效日起至今（2013年10月25	10.27%	0.89%	19.65%	0.13%	-9.38%	0.76%

日-2016年06月30日）						

注：1、本基金业绩比较基准为：中债总财富总指数，

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：

Return t =中债总财富总指数t / 中债总财富总指数(t-1) -1

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

其中，t =1，2，3，…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

富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013年10月25日-2016年06月30日）

注：本基金于2013年10月25日成立。根据《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合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2014年4月24日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金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责任公司、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新区世纪大道1568号中建大厦29层，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6月30日，公司共管理八只开放式基金：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、富安达现金通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、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。

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		
李飞先生	本基金的基金经理、富安达增强收益债券型证券投资基金基金经理、富安达长盈保本混合型证	2013年10月25日	—	12年	历任上海技术应用技术学院财政经济系教师；聚源数据有限责任公司研究发展中心项目经理；国盛证券有限责任公司投资研究部高级宏观债券研究员；金元惠理基金管理有限公司投资部基金经理，博士研究生，具有基金从业资格，中国国籍

	券投资基金基金经理、公司固定收益部副总监（主持工作）、投资管理部总监助理（主持工作）				
张凯瑜女士	本基金的基金经理、富安达现金通货币市场证券投资基金基金经理	2013年10月25日	—	8年	历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理员；爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员，硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍

注：1、任职日期和离任日期均指公司做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遵规守信情况的说明

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、《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2016年上半年，中国经济表现总体平稳。经济增长速度略有回落，但依旧运行在政府可容忍区间内，通胀水平虽有起伏，但总体依旧良好可控。结构性矛盾显现，中央宏观政策上加大了企业债务清理，削减过剩产能，供给侧改革则作为重中之重，有扶有控信贷，支持企业“三去一降一补”。美联储在2015年底首次加息后，资金开始逐渐从新兴市场向美国回流，制约我国货币政策边际上难以继续宽松，人民币再度加速贬值。而监管政策上则显著从严，金融反腐，倒逼资金脱虚向实。年初首月A股四次触发熔断，市场信心极度萎缩，风险偏好大幅收敛，股市出现了超预期的调整，并进入了漫漫磨底的阶段。而债券市场则总体平稳，强烈的避险资金推动下，利率债和高资质信用债短端一度下行；但信贷和M2的反弹，债市供给扩增，二季度利率债收益震荡上行。债券违约频发，造成过剩产能行业债券收益率一路走高，信用风险显著恶化，利差略有走阔。本基金对年初跨年度行情过于乐观，对转债类资产配置较高，因此在风险极度释放、泥沙俱下的一月行情中净值损失较多，对此深表歉意。二季度本基金债券组合保持适当杠杆，降低了组合久期，对波动性较高的转债做了相应的交易性操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，富安达信用主题轮动纯债债券型发起式A基金份额净值为1.1156元，本报告期净值增长率为-15.66%；富安达信用主题轮动纯债债券型发起式C基金份额净值为1.1027元，本报告期净值增长率为-15.83%，同期业绩比较基准增长率为1.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过长达一年多的调整，股市已经较为充分反应经济L型逐级减速、人民币贬值、大小非减持、市场扩容等风险。总体上，我们认为股指下跌空间较小，三季度市场将会延续反弹，但受制于存量博弈，难以产生趋势性大行情。对于下半年债券市场，我们坚持顺势而为，在加大公共债务率，提升政府债务置换规模的背景下，我们认为债券难以获取较多的净价收益，但基本面上对债市依旧有支撑，出现大幅调整的概率也不大，因此保持适度杠杆和久期的情况下，适度波段交易或许是较好的策略。随着债务到期，流动性难以进一步放松情况下，需要更加严格控制信用违约风险，紧密跟踪政府供给侧改革政策进展，研判对城投债和相关产业债的投资价值。

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

本基金为发起式基金，截止6月30日规模低于5000万。基金运作未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-富安达基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016年 6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,富安达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，富安达基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	304,389.82	28,056.25
结算备付金		904,982.38	951,368.21
存出保证金		5,196.38	16,593.55
交易性金融资产	6.4.7.2	22,597,738.00	25,695,613.80
其中：股票投资		—	—

基金投资		—	—
债券投资		22,597,738.00	25,695,613.80
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	—	—
应收证券清算款		—	274,023.24
应收利息	6.4.7.5	199,787.43	132,811.26
应收股利		—	—
应收申购款		5,713.10	23,052.28
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		24,017,807.11	27,121,518.59
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2016年06月30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		—	—
卖出回购金融资产款		8,500,000.00	7,600,000.00
应付证券清算款		226,891.10	—
应付赎回款		7,049.80	48,100.17
应付管理人报酬		8,500.91	11,701.34
应付托管费		2,428.83	3,343.26
应付销售服务费		585.18	856.22
应付交易费用	6.4.7.7	—	—
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—

其他负债	6.4.7.8	300,340.93	440,074.08
负债合计		9,045,796.75	8,104,075.07
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	13,438,913.69	14,394,456.66
未分配利润	6.4.7.10	1,533,096.67	4,622,986.86
所有者权益合计		14,972,010.36	19,017,443.52
负债和所有者权益总计		24,017,807.11	27,121,518.59

注：报告截止日2016年6月30日，富安达信用主题轮动纯债A类基金份额净值1.1156元，富安达信用主题轮动纯债C类基金份额净值1.1027元；富安达信用主题轮动纯债基金份额总额13,438,913.69份（其中A类11,853,792.98份，C类1,585,120.71份）。

6.2 利润表

会计主体：富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年01月01日-2016年06月30日	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日
一、收入		-2,747,611.02	3,642,296.71
1.利息收入		203,318.27	484,898.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,320.90	11,305.08
债券利息收入		193,997.37	473,593.60
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益		-2,494,258.95	3,752,517.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—

债券投资收益	6.4.7.13	-2,494,258.95	3,752,517.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—	—
股利收益	6.4.7.16	—	—
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	-457,319.31	-598,368.16
4.汇兑收益（损失以“—”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	648.97	3,248.74
减：二、费用		159,345.05	381,336.94
1．管理人报酬		56,123.84	92,664.30
2．托管费		16,035.36	26,475.47
3．销售服务费		4,167.77	14,786.17
4．交易费用	6.4.7.19	874.56	2,379.36
5．利息支出		91,380.26	85,497.02
其中：卖出回购金融资产支出		91,380.26	85,497.02
6．其他费用	6.4.7.20	-9,236.74	159,534.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,906,956.07	3,260,959.77
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,906,956.07	3,260,959.77

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日-2016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)	14,394,456.66	4,622,986.86	19,017,443.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-2,906,956.07	-2,906,956.07
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）	-955,542.97	-182,934.12	-1,138,477.09
其中：1.基金申购款	2,214,276.12	389,537.06	2,603,813.18
2.基金赎回款	-3,169,819.09	-572,471.18	-3,742,290.27
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）	13,438,913.69	1,533,096.67	14,972,010.36
项 目	上年度可比期间 2015年01月01日-2015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)	16,169,040.43	4,134,685.80	20,303,726.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	3,260,959.77	3,260,959.77
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）	2,067,456.83	1,184,251.61	3,251,708.44
其中：1.基金申购款	22,409,714.47	10,206,967.99	32,616,682.46
2.基金赎回款	-20,342,257.64	-9,022,716.38	-29,364,974.02

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）	18,236,497.26	8,579,897.18	26,816,394.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金(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[2013]932号《关于核准富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式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628,939,222.15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676号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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合同》于2013年10月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为628,975,830.26份基金份额，其中认购资金利息折合36,608.11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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

根据经批准的《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合同》和《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认(申)购费收取方式的不同，将基金份额分为A类和C类。认(申)购基金时收取认(申)购费的，称为A类基金份额；不收取认(申)购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。投资人可自行选择认(申) 购的基金份额类别，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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，包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、商业银行次级债、企业债、中小企业私募债券、非公开定向债务融资工具、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、可转换债券(其中分离交易可转债仅包含其公司债部分)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，其中信用债券投资不低于非现金基金资产的80%，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准：中债总指数收益率。

6.4.2 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》、《富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 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2016年06月30日的财务状况以及2016年01月01日至2016年06月30日止期间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、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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《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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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股票、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股票、债券的转让收入免征增值税，对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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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

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
中国农业银行股份有限公司（"农业银行")	基金托管人、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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付给关联方的佣金。

6.4.8.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
南京证券股份有限公司（"南京证券"）	76,957,118.56	100.00%	262,774,976.55	100.00%

6.4.8.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
南京证券股份有限公司（"南京证券"）	1,138,000,000.00	100.00%	809,850,000.00	100.00%

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	56,123.84	92,664.30
其中：支付销售机构的客户维护费	37,671.87	22,897.40

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0.7%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 ×0.7% / 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日	上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,035.36	26,475.47

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%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 × 0.2% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达信用主题A	富安达信用主题C	合计
富安达基金管理有限公司	—	43.53	43.53
农业银行股份有限公司	—	1,554.69	1,554.69
南京证券股份有限公司	—	350.90	350.90
合计	—	1949.12	1949.12
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-2015年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达信用主题A	富安达信用主题C	合计
富安达基金管理有限公司	—	165.09	165.09
农业银行股份有限公司	—	8,285.24	8,285.24
南京证券股份有限公司	—	1,330.32	1,330.32
合计	—	9780.65	9780.65

注：支付基金销售机构的信用主题纯债C类销售服务费按前一日信用主题纯债C类基金资产净值0.4%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。信用主题纯债A类不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费＝前一日信用主题纯债C类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告内未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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01月01日-2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日	
	富安达信用主题A	富安达信用主题C	富安达信用主题A	富安达信用主题C
期初持有的基金份额	9,999,000.00	-	9,999,000.00	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	9,999,000.00	-	9,999,000.00	-
占基金总份额比例	74.40%	-	54.83%	-

本基金管理人在本期未申购、赎回本基金，基金份额未发生变动。

6.4.8.4.2 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

本基金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。

6.4.8.5 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01月01日-2016年06月30日		上年度可比期间 2015年01月01日-2015年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	304,389.82	1,020.98	1,242,139.98	4,282.24

注：1、本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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“农业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(2015年6月30日：同)。

6.4.8.6 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证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2016年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未因认购新股/新债而持有流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至2016年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额8,500,000.00元，于2016年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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	权益投资	—	—

	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	22,597,738.00	94.09
	其中：债券	22,597,738.00	94.09
	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	1,209,372.20	5.04
7	其他资产	210,696.91	0.88
8	合计	24,017,807.11	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未买卖股票。

7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,048,895.10	7.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	5,807,535.20	38.79
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	15,741,307.70	105.14
8	其他	-	-
9	合计	22,597,738.00	150.93

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110035	白云转债	18,500	2,192,435.00	14.64
2	113009	广汽转债	17,500	2,076,025.00	13.87
3	128009	歌尔转债	14,890	1,917,683.10	12.81
4	132001	14宝钢EB	14,300	1,647,360.00	11.00
5	132003	15清控EB	14,580	1,605,841.20	10.73

7.7 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。

7.8 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投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

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。

7.12.2 基金投资前十名股票中投资于基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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。

7.12.3 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	5,196.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	199,787.43
5	应收申购款	5,713.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	210,696.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	1,917,683.10	12.81
2	110031	航信转债	998,124.50	6.67

3	110030	格力转债	945,870.00	6.32
4	113008	电气转债	540,550.00	3.61
5	123001	蓝标转债	215,076.90	1.44

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§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
富安达信用主题A	504	23,519.43	9,999,000.00	84.35%	1,854,792.98	15.65%
富安达信用主题C	363	4,366.72	-	-	1,585,120.71	100.00%
合计	867	15,500.48	9,999,000.00	74.40%	3,439,913.69	25.60%

8.2 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	富安达信用主题A	7.34	-
	富安达信用主	-	-

	题C		
	合计	7.34	—

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	富安达信用主题A	0
	富安达信用主题C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达信用主题A	0
	富安达信用主题C	0
	合计	0

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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,000.00	74.40%	9,999,000.00	74.40%	3年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	9,999,000.00	74.40%	9,999,000.00	74.40%	

注：本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，公司股东和从业人员认购的基金份额不属于发起式份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达信用主题A	富安达信用主题C
基金合同生效日(2013年10月25日)基金份额总额	200,309,769.85	428,666,060.41
本报告期期初基金份额总额	12,531,290.04	1,863,166.62
本报告期基金总申购份额	1,004,017.46	1,210,258.66
减：本报告期基金总赎回份额	1,681,514.52	1,488,304.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,853,792.98	1,585,120.71

§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总经理办公会〔2016〕2号决议通过，免去孔学兵为富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理。本基金管理人已于2016年1月30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优势成长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。

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，免去孔学兵同志为富安达基金管理有限公司第二届职工董事，同意金领千同志为富安达基金管理有限公司第6届职工董事。

基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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。

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）。

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及其相关高级管理人员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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
南京证券	2	-	-	76,957,118.56	100.00%	1,138,000,000.00	100.00%	-	-	-	-	

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：

（1）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；

（2）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；

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

（4）能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

（5）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：

（1）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。

（2）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。

（3）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。

（4）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、本报告期没有新增的券商交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

富安达基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日