

**富安达长盈保本混合型证券投资基金**

**2016年第3季度报告**

**2016年9月30日**

**基金管理人：富安达基金管理有限公司**

**基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司**

**报告送出日期：2016年10月24日**

## § 1 重要提示及目录

### 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。基金托管人浦发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年07月01日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	富安达长盈保本混合
基金主代码	002584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月11日
报告期末基金份额总额	284,475,021.75份
投资目标	通过运用投资组合保险技术，有效控制本金损失的风险，在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金运用 CPPI 恒定比例组合保险策略，动态调整安全资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保保本周期到期时，基金资产在保本基础上实现保值增值的目的。
业绩比较基准	二年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日-2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,687,420.65
2. 本期利润	1,751,526.09
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0055
4. 期末基金资产净值	286,592,968.99
5. 期末基金份额净值	1.007

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，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本基金于2016年5月11日成立。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	0.50%	0.03%	0.53%	0.01%	-0.03%	0.02%

注：①本基金业绩比较基准为：二年期银行定期存款收益率

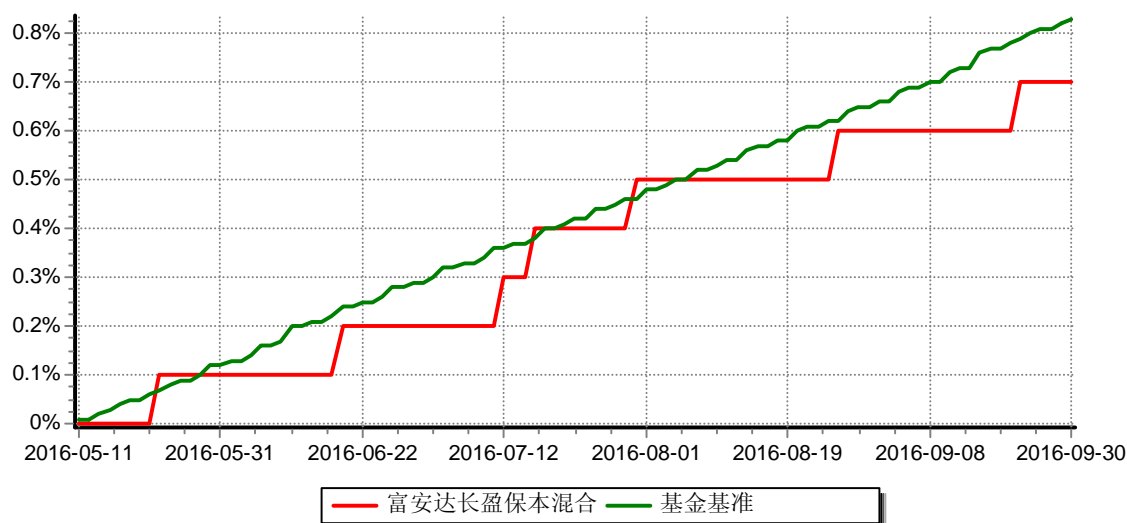
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return } t = \text{今日指数}t / \text{昨日指数}(t-1) - 1$$

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

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2016年5月11日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2016年5月11日）起6个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李飞	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、富安达信用主题纯	2016年5月11日	—	12年	历任上海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

	债债券型发起式证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	本基金的基金经理、富安达现金货币市场证券投资基金基金经理、富安达信用主题纯债债券型发起式证券投资基金基金经理	2016年7月22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、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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达长盈保本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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2016年三季度海外经济弱复苏，英国成功脱欧，美联储加息预期升温，黄金价格高位震荡下行，OPEC减产预期使得原油价格上行。国内经济则平稳运行，采购经理指数（PMI）在50荣枯线附近窄幅波动，但投资工业生产等产出数据依旧羸弱，民间投资增速继续回落。房地产市场火爆，7月新增房贷占全部新增贷款比例超过100%，表明居民不看好经济增长而将房产作为避风港，M1继续超高速增长，倒逼政策难以继续放松，中央严控资产泡沫，国内各大城市普遍开始出台限购限贷等地产调控政策。A股市场依旧缩量窄幅盘整，多数情况下个股环涨急跌，缺乏一定的赚钱效应，在结构上低估值蓝筹和举牌类个股相对领涨。

债券收益率先跌后涨。7月经济金融数据明显低于预期，叠加配置需求，收益率在

中旬快速下行，突破年内低点；但央行重启14天和28天逆回购，锁短放长，倒逼机构降杠杆，资金面先松后紧，重启引发市场对资金面的担忧，收益率有所回升。总体上，1年和10年期国债估值分别下行了20和10bp不等，中低评级债收益下行显著，期限利差和信用利差进一步压缩。报告期内本基金继续建立保本组合，积累保本垫，主要投资方向为期限匹配的高等级信用债和利率债。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年9月30日，本报告期富安达长盈保本混合份额净值为1.007元，净值增长率为0.50%，同期业绩比较基准增长率为0.53%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	129,786,849.10	30.19
	其中：债券	129,786,849.10	30.19
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	128,000,000.00	29.77
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	26,236,321.31	6.10
8	其他资产	145,940,270.86	33.94
9	合计	429,963,441.27	100.00

注:由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票资产。

### 5.3 报告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资产。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,412,180.00	10.26
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中:政策性金融债	—	—
4	企业债券	40,055,669.10	13.98
5	企业短期融资券	50,158,000.00	17.50
6	中期票据	10,161,000.00	3.55
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	129,786,849.10	45.29

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011699685	16中建材SCP004	200,000	20,082,000.00	7.01
2	112138	12苏宁01	141,000	14,501,850.00	5.06
3	019546	16国债18	140,000	13,998,600.00	4.88



4	020140	16贴债42	132,580	13,124,094.20	4.58
5	122392	15恒大02	103,510	10,680,161.80	3.73

#### 5.6 报告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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 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。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.2 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

##### 5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,690.25
2	应收证券清算款	144,060,067.87

3	应收股利	—
4	应收利息	1,877,512.74
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	145,940,270.86

#### 5.11.4 报告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可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票资产。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	376,386,143.24
报告期期间基金总申购份额	89,798.29
减：报告期期间基金总赎回份额	92,000,919.78
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	284,475,021.75

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况，不存在利益冲突、显失公平的关联交易的情况。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内不存在基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2016年7月1日, 富安达基金管理有限公司2016年6月30日基金净值公告
- 2、2016年7月9日, 富安达长盈保本混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告

3、2016年7月9日,关于富安达长盈保本混合型证券投资基金参加部分销售机构定期定额投资及申购基金费率优惠活动的公告

4、2016年7月18日,富安达基金管理有限公司关于参加兴业证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告

5、2016年7月22日,富安达长盈保本混合型证券投资基金基金经理变更公告

6、2016年9月13日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加华龙证券股份有限公司为代销机构并参与费率优惠活动的公告

7、2016年9月13日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加光大证券股份有限公司为代销机构并参与费率优惠活动的公告

8、2016年9月20日,富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资手续费率优惠的公告

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准富安达长盈保本混合型证券投资基金设立的文件:

《富安达长盈保本混合型证券投资基金招募说明书》;

《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》;

《富安达长盈保本混合型证券投资基金托管协议》。

2. 《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

3. 基金管理人业务资格批件和营业执照;

4. 基金托管人业务资格批件和营业执照;

5. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;

6. 中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所,供公众查阅、复制。

### 9.3 查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。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](http://www.fadfunds.com))查阅。

富安达基金管理有限公司

二〇一六年十月二十四日