

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告

2016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：2016年8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。

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 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 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 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| §5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| §7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 36 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 40 |
| 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 | 40 |
| 7.7 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 40 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 40 |
| §8 基金份额持有人信息 | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 42 |
| 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 | 42 |
| §9 开放式基金份额变动 | 42 |
| §10 重大事件揭示 | 43 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 43 |
| 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 | 43 |

| | | |
|------|--------------------------------|----|
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 43 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 43 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 43 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 43 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 44 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 45 |
| §11 | 备查文件目录 | 48 |
| 11.1 | 备查文件目录 | 48 |
| 11.2 | 存放地点 | 48 |
| 11.3 | 查阅方式 | 48 |

§ 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 | 56,547,894.55份 |
| 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 |
| 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 |
|--------|-------------|-------------------------|
| 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（2016年1月1日至2016年6月30日） |
| 本期已实现收益 | -8,298,507.63 |
| 本期利润 | -2,302,672.01 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0211 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.61% |
| 本期基金份额净值增长率 | 10.15% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 4,231,389.62 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0748 |
| 期末基金资产净值 | 81,219,161.72 |
| 期末基金份额净值 | 1.4363 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 43.63% |

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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 8.93% | 2.29% | 1.07% | 0.85% | 7.86% | 1.44% |
| 过去三个月 | 8.54% | 2.19% | -0.72% | 0.84% | 9.26% | 1.35% |
| 过去六个月 | 10.15% | 2.36% | -10.62% | 1.39% | 20.77% | 0.97% |

| | | | | | | |
|--|--------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去一年 | 10.48% | 1.65% | -15.67% | 1.70% | 26.15% | -0.05% |
| 自基金合同生效日起 至今（2014年09月11 日-2016年06月30日） | 43.63% | 1.62% | 22.89% | 1.51% | 20.74% | 0.11% |

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，

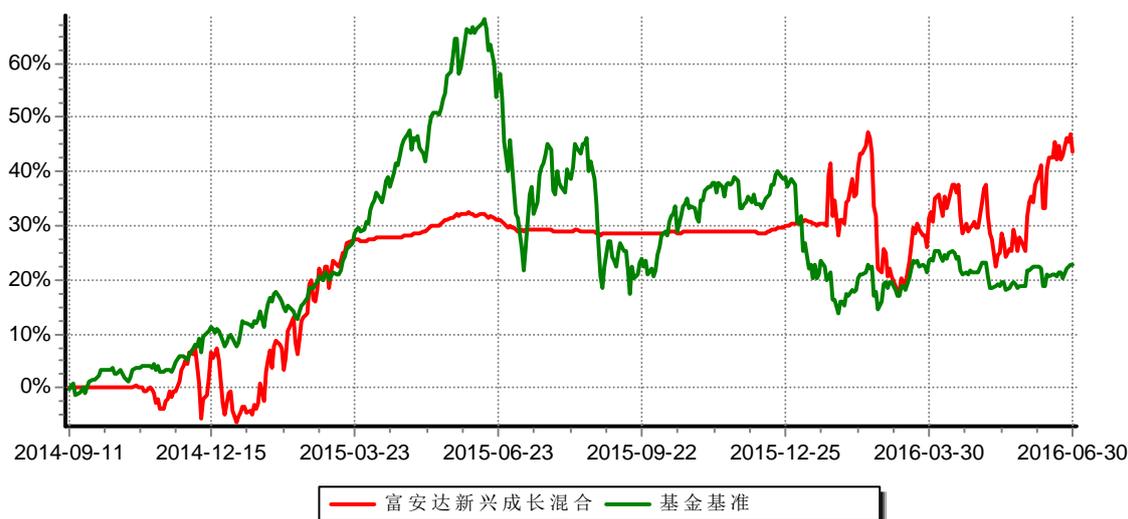
2、本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

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

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

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。本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2015年3月10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 | | |
| 孙绍冰 | 本基金的基金经理、公司研究发展部总监助理 | 2015年5月22日 | — | 9年 | 历任齐鲁证券研究所行业研究员，富安达基金管理有限公司研究发展部高级行业研究员兼基金经理助理，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、《富安达新兴成长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，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

报告期内，年初受汇率贬值、注册制改革等因素影响，资本市场深度回调；后期随着宏观经济的季度性回暖，市场震荡走高；但受持续宽松预期落空、美国加息等利空因素打压，市场情绪总体低迷，主要指数低位震荡，主板、创业板、中小板上半年均以绿盘报收，其中主板情况略好。虽然市场总体低迷，但确定性行业及个股不乏精彩，景气度向上、符合国家产业政策的行业受到市场认可，相当一部分个股股价创下历史新高。

投资策略方面：我们积极布局战略新兴产业，在市场深度调整阶段，我们加大了对相关行业的挖掘和研究，适当加大了安全边际较高的行业以及个股的配置，我们希望在减少净值回撤风险的前提下，通过把握确定性较高的行业和个股的投资机会，以实现基金净值的稳健增长，而最终通过我们的努力，新兴成长确实获得了较好的投资回报，二季度跑赢业绩基准。

行业配置方面，我们认为能够穿越周期的更多是代表未来经济发展方向的战略新兴产业，与此有关的电子信息、智能制造、生物医药、新能源汽车等行业将进行重点配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，本基金份额净值为1.4363元，本报告期份额净值增长率为10.15%，同期业绩比较基准收益率为-10.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过年初以来的几波回撤，我们认为市场对宏观经济的悲观预期已经在指数上得到充分体现，权重板块估值风险不高，市场向下空间不大；预判宏观经济未来走势依然低迷，经济增长动力仍然疲弱，因而指数不具备持续向上的动力；市场呈弱势震荡格局，期间诸如英国脱欧等因素料将会形成一定扰动，但不起决定作用，我们认为最终决定市场指数走势的依然是国内经济走势。

市场虽然呈弱势震荡格局，但结构性机会活跃，上半年新能源汽车产业链、电子、食品饮料、家电等行业板块赚钱机会明显，下半年精选行业和个股仍是本基金的重要工

作，景气度向上、符合国家产业政策的行业是重点配置领域。我们将重点关注景气度向上的板块和个股，主要包括电子信息、物联网、智能装备、新能源汽车等。

本基金将在市场分化过程中发挥“自下而上”精选个股的优势，配合适时的仓位控制，力争为投资者带来较好的投资回报。

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

2016年上半年度，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《中华人民共和国证券投资基金法》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年上半年度，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

2016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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 6,207,050.52 | 96,187.07 |
| 结算备付金 | | 324,951.97 | 767,942,796.64 |
| 存出保证金 | | 81,781.94 | 47,180.60 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 77,062,769.87 | 22,981,281.62 |
| 其中：股票投资 | | 77,062,769.87 | 22,981,281.62 |
| 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 | 6.4.7.3 | — | — |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | — | — |
| 应收证券清算款 | | 953,938.87 | 1,743,430.14 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,385.68 | 279,460.67 |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | 1,839,945.64 | 42,688.67 |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | — | — |
| 资产总计 | | 86,471,824.49 | 793,133,025.41 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6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 | 6.4.7.3 | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | | — | — |
| 应付证券清算款 | | — | — |
| 应付赎回款 | | 4,474,750.37 | 84,419.64 |
| 应付管理人报酬 | | 79,220.35 | 1,522,540.79 |
| 应付托管费 | | 13,203.40 | 253,756.80 |
| 应付销售服务费 | | — | — |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 166,309.74 | 272,881.87 |
| 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 | 519,178.91 | 410,072.72 |
| 负债合计 | | 5,252,662.77 | 2,543,671.82 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 56,547,894.55 | 606,321,031.54 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 24,671,267.17 | 184,268,322.05 |
| 所有者权益合计 | | 81,219,161.72 | 790,589,353.59 |
| 负债和所有者权益总计 | | 86,471,824.49 | 793,133,025.41 |

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.4363元，基金份额总额56,547,894.55份。

6.2 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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------------------|------------|------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | -115,711.35 | 89,189,506.52 |
| 1.利息收入 | | 1,120,514.12 | 6,079,342.25 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 643,357.83 | 6,079,297.72 |
| 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 | | 477,156.29 | 44.53 |
| 其他利息收入 | | — | — |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -8,798,292.39 | 24,821,085.63 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -8,909,574.53 | 24,653,520.88 |
| 基金投资收益 | | — | — |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | — | — |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.2 | — | — |
| 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 | 111,282.14 | 167,564.75 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 5,995,835.62 | 57,762,032.87 |
| 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 | 1,566,231.30 | 527,045.77 |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------|---------------|
| 填列 | | | |
| 减：二、费用 | | 2,186,960.66 | 11,534,694.14 |
| 1. 管理人报酬 | | 1,056,822.08 | 9,383,221.86 |
| 2. 托管费 | | 176,137.04 | 1,563,870.45 |
| 3. 销售服务费 | | — | — |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 728,884.93 | 422,436.72 |
| 5. 利息支出 | | — | — |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | — | — |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 225,116.61 | 165,165.11 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -2,302,672.01 | 77,654,812.38 |
| 减：所得税费用 | | — | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -2,302,672.01 | 77,654,812.38 |

6.3 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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2016年1月1日至2016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(基金净值) | 606,321,031.54 | 184,268,322.05 | 790,589,353.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | -2,302,672.01 | -2,302,672.01 |
| 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） | -549,773,136.99 | -157,294,382.87 | -707,067,519.86 |
| 其中：1.基金申购款 | 107,858,983.62 | 42,008,886.22 | 149,867,869.84 |
| 2.基金赎回款 | -657,632,120.6 | -199,303,269.0 | -856,935,389.70 |

| | 1 | 9 | |
|--|---------------------------------|----------------|------------------|
| 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） | 56,547,894.55 | 24,671,267.17 | 81,219,161.72 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2015年1月1日至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(基金净值) | 104,679,160.39 | -5,334,081.13 | 99,345,079.26 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | — | 77,654,812.38 | 77,654,812.38 |
| 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） | 1,666,707,696.77 | 459,039,151.51 | 2,125,746,848.28 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,815,946,586.37 | 489,217,119.94 | 2,305,163,706.31 |
| 2.基金赎回款 | -149,238,889.60 | -30,177,968.43 | -179,416,858.03 |
| 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） | 1,771,386,857.16 | 531,359,882.76 | 2,302,746,739.92 |

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]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共募集人民币249,339,317.51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(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(以下简称“交通银行”)。

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、央行票、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(但需符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%;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%。本基金的业绩比较基准:中证新兴产业指数收益率 \times 60%+中债总指数收益率 \times 40%。

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》、《富安达新兴成长灵活配置混合型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年上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6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日期间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 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《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 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 2016年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 6,207,050.52 |
| 定期存款 | — |
| 其中：存款期限1-3个月 | — |
| 其他存款 | — |
| 合计 | 6,207,050.52 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 | | |
|---------------|----------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 59,384,268.11 | 77,062,769.87 | 17,678,501.76 |
| 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 | 59,384,268.11 | 77,062,769.87 | 17,678,501.76 |

6.4.7.3 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。

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返售金融资产

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通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,096.42 |
| 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 | 247.60 |
| 应收债券利息 | — |
| 应收买入返售证券利息 | — |
| 应收申购款利息 | 8.45 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | — |
| 其他 | 33.21 |
| 合计 | 1,385.68 |

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 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 166,309.74 |
| 银行间市场应付交易费用 | — |
| 合计 | 166,309.74 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2016年6月30日 |
|-------------|------------|
| 应付券商交易单元保证金 | — |
| 应付赎回费 | 2,407.30 |
| 预提费用 | 516,771.61 |
| 合计 | 519,178.91 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|---------------|------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 606,321,031.54 | 606,321,031.54 |
| 本期申购 | 107,858,983.62 | 107,858,983.62 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -657,632,120.61 | -657,632,120.61 |
| 本期末 | 56,547,894.55 | 56,547,894.55 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | 120,458,558.45 | 63,809,763.60 | 184,268,322.05 |
| 本期利润 | -8,298,507.63 | 5,995,835.62 | -2,302,672.01 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -107,928,661.20 | -49,365,721.67 | -157,294,382.87 |
| 其中：基金申购款 | 20,153,448.39 | 21,855,437.83 | 42,008,886.22 |
| 基金赎回款 | -128,082,109.59 | -71,221,159.50 | -199,303,269.09 |
| 本期已分配利润 | — | — | — |
| 本期末 | 4,231,389.62 | 20,439,877.55 | 24,671,267.17 |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 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6月30日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

| | |
|-----------|------------|
| 活期存款利息收入 | 17,214.02 |
| 定期存款利息收入 | — |
| 其他存款利息收入 | — |
| 结算备付金利息收入 | 625,565.38 |
| 其他 | 578.43 |
| 合计 | 643,357.83 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------------------|------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票 差价收入 | -8,909,574.53 |
| 股票投资收益——赎回差价 收入 | — |
| 合计 | -8,909,574.53 |

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 228,046,719.28 |
| 减：卖出股票成本总额 | 236,956,293.81 |
| 买卖股票差价收入 | -8,909,574.53 |

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内未获得基金投资收益

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内未获得债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未获得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内未获得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未获得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 111,282.14 |
| 基金投资产生的股利收益 | — |
| 合计 | 111,282.14 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 5,995,835.62 |
| ——股票投资 | 5,995,835.62 |
| ——债券投资 | — |
| ——资产支持证券投资 | — |
| ——基金投资 | 0 |
| ——贵金属投资 | — |
| ——其他 | — |
| 2.衍生工具 | — |
| ——权证投资 | — |
| 3.其他 | — |
| 合计 | 5,995,835.62 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,556,062.44 |
| 基金转换费收入 | 10,168.86 |
| 合计 | 1,566,231.30 |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额归入基金资产的比例按持有期间递减。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 728,884.93 |
| 银行间市场交易费用 | — |
| 合计 | 728,884.93 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 49,726.04 |
| 信息披露费 | 157,045.57 |
| 其他 | 200.00 |
| 帐户维护费 | 18,000.00 |
| 汇划手续费 | 145.00 |
| 合计 | 225,116.61 |

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作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**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 南京证券 | | — | 18,985,781.28 | 7.52% |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|----------------|--------------|------------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金 余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| | 17,284.73 | 7.52% | | — |

注：上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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 2016年1月1日至2016年6 月30日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日 |
|---------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管 理费 | 1,056,822.08 | 9,383,221.86 |
| 其中：支付销售机构的客户 维护费 | 585,333.41 | 6,106,528.77 |

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。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 176,137.04 | 1,563,870.45 |

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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。

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。

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**

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 | | 上年度末 | |
|-----------------|--------------|------------------|--------------|------------------|
| | 2016年6月30日 | | 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 |
| 富安达资产管理（上海）有限公司 | 7,738,565.13 | 13.68% | 7,738,565.13 | 1.28% |

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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------|-----------|----------------------|--------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 2015年1月1日至2015年6月30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 | 6,207,050.52 | 17,214.02 | 1,934,517,861.0 | 2,562,131.19 |

| | | | |
|----|--|--|---|
| 存款 | | | 0 |
|----|--|--|---|

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|-----------|-------|--------|---------|--------------|--------------|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
| 002781 | 奇信股份 | 2015-12-16 | 2016-12-22 | 网下配售安排锁定期 | 13.31 | 43.35 | 204,545 | 2,722,493.95 | 8,867,025.75 |
| 300488 | 恒锋工具 | 2015-06-25 | | 网下配售安排锁定期 | 20.11 | 73.32 | 71,341 | 1,434,667.51 | 5,230,722.12 |

6.4.12.2 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 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|
| 002569 | 步森股份 | 2016-01-04 | 重大资产重组 | 35.58 | 2016-07-19 | 39.28 | 20,000 | 720,000.00 | 711,600.00 |
| 300488 | 恒锋工具 | 2016-04-01 | 重大资产重组 | 73.32 | | — | 71,341 | 1,434,667.51 | 5,230,722.12 |
| 002355 | 兴民钢圈 | 2016-05-12 | 重大事项 | 19.35 | | — | 130,000 | 2,486,617.26 | 2,515,500.00 |

| | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|-------|------------|-------|--------|--------------|--------------|
| 300351 | 永贵电器 | 2016-06-29 | 非公开发行股份 | 33.93 | 2016-07-04 | 33.30 | 90,000 | 2,643,653.06 | 3,053,700.00 |
|--------|------|------------|---------|-------|------------|-------|--------|--------------|--------------|

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告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。

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

本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的预期风险、预期收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

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、总经理、董事会及中国证监会。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

于2016年6月30日，本基金未持债券投资（2015年12月31日：同）

6.4.13.3 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通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金的基金管理人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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016年6月30 日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 6,207,050.52 | — | — | — | 6,207,050.52 |
| 结算备付金 | 324,951.97 | — | — | — | 324,951.97 |
| 存出保证金 | 81,781.94 | — | — | — | 81,781.94 |
| 交易性金融资产 | — | — | — | 77,062,769.87 | 77,062,769.87 |
| 应收证券清算款 | — | — | — | 953,938.87 | 953,938.87 |
| 应收利息 | — | — | — | 1,385.68 | 1,385.68 |
| 应收申购款 | — | — | — | 1,839,945.64 | 1,839,945.64 |
| 资产总计 | 6,613,784.43 | — | — | 79,858,040.06 | 86,471,824.49 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | — | — | — | 4,474,750.3 | 4,474,750.3 |

| | | | | | |
|---------------------|----------------|------|------|---------------|----------------|
| | | | | 7 | 7 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | 79,220.35 | 79,220.35 |
| 应付托管费 | — | — | — | 13,203.40 | 13,203.40 |
| 应付交易费用 | — | — | — | 166,309.74 | 166,309.74 |
| 其他负债 | — | — | — | 519,178.91 | 519,178.91 |
| 负债总计 | — | — | — | 5,252,662.77 | 5,252,662.77 |
| 利率敏感度缺口 | 6,613,784.43 | — | — | 74,605,377.29 | 81,219,161.72 |
| 上年度末 2015年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 96,187.07 | — | — | — | 96,187.07 |
| 结算备付金 | 767,942,796.64 | — | — | — | 767,942,796.64 |
| 存出保证金 | 47,180.60 | — | — | — | 47,180.60 |
| 交易性金融资产 | — | — | — | 22,981,281.62 | 22,981,281.62 |
| 应收证券清算款 | — | — | — | 1,743,430.14 | 1,743,430.14 |
| 应收利息 | — | — | — | 279,460.67 | 279,460.67 |
| 应收申购款 | — | — | — | 42,688.67 | 42,688.67 |
| 资产总计 | 768,086,164.31 | — | — | 25,046,861.10 | 793,133,025.41 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | — | — | — | 84,419.64 | 84,419.64 |
| 应付管理人报酬 | — | — | — | 1,522,540.79 | 1,522,540.79 |
| 应付托管费 | — | — | — | 253,756.80 | 253,756.80 |
| 应付交易费用 | — | — | — | 272,881.87 | 272,881.87 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---|---|---------------|----------------|
| 其他负债 | — | — | — | 410,072.72 | 410,072.72 |
| 负债总计 | — | — | — | 2,543,671.82 | 2,543,671.82 |
| 利率敏感度缺口 | 768,086,164.31 | — | — | 22,503,189.28 | 790,589,353.59 |

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

| | | | |
|----|---|-----------------------------|---------------------|
| 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6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| | 利率下降25个基点 | — | — |
| | 利率上升25个基点 | — | — |

注：截至报告期末，本基金未持有交易性债券投资(2015年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015年12月31日：同)。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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，结合联储模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测，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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为0%-95%；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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 | | 上年度末 2015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 | 77,062,769.87 | 94.88 | 22,981,281.62 | 2.91 |
| 衍生金融资产-权证投资 | — | — | — | — |
| 其他 | — | — | — | — |
| 合计 | 77,062,769.87 | 94.88 | 22,981,281.62 | 2.91 |

6.4.13.4.3.2 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6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| | 5% | 8,147,461.34 | 1,940,896.86 |
| | -5% | -8,147,461.34 | -1,940,896.86 |

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（元） | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 77,062,769.87 | 89.12 |
| | 其中：股票 | 77,062,769.87 | 89.12 |
| 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 | 6,532,002.49 | 7.55 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,877,052.13 | 3.33 |
| 8 | 合计 | 86,471,824.49 | 100.00 |

注：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。

7.2 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 | 66,642,260.12 | 82.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | 8,867,025.75 | 10.92 |
| F | 批发和零售业 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,404,700.00 | 1.73 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 24,984.00 | 0.03 |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | — | — |
| L | 租赁和商务服务业 | — | — |
| M | 科学研究和技术服务业 | 123,800.00 | 0.15 |
| 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 | — | — |
| | 合计 | 77,062,769.87 | 94.88 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 002781 | 奇信股份 | 204,545 | 8,867,025.75 | 10.92 |
| 2 | 300488 | 恒锋工具 | 71,341 | 5,230,722.12 | 6.44 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 3 | 002048 | 宁波华翔 | 220,000 | 5,031,400.00 | 6.19 |
| 4 | 300073 | 当升科技 | 65,000 | 4,351,100.00 | 5.36 |
| 5 | 002709 | 天赐材料 | 52,000 | 3,636,880.00 | 4.48 |
| 6 | 002590 | 万安科技 | 110,000 | 3,424,300.00 | 4.22 |
| 7 | 002340 | 格林美 | 360,000 | 3,157,200.00 | 3.89 |
| 8 | 002108 | 沧州明珠 | 120,000 | 3,108,000.00 | 3.83 |
| 9 | 300100 | 双林股份 | 70,000 | 3,066,700.00 | 3.78 |
| 10 | 300351 | 永贵电器 | 90,000 | 3,053,700.00 | 3.76 |
| 11 | 603023 | 威帝股份 | 150,000 | 2,889,000.00 | 3.56 |
| 12 | 002407 | 多氟多 | 65,500 | 2,789,645.00 | 3.43 |
| 13 | 002284 | 亚太股份 | 145,000 | 2,768,050.00 | 3.41 |
| 14 | 002355 | 兴民钢圈 | 130,000 | 2,515,500.00 | 3.10 |
| 15 | 002436 | 兴森科技 | 100,000 | 2,279,000.00 | 2.81 |
| 16 | 601799 | 星宇股份 | 47,000 | 2,153,540.00 | 2.65 |
| 17 | 002070 | 众和股份 | 75,000 | 1,893,750.00 | 2.33 |
| 18 | 002371 | 七星电子 | 41,000 | 1,714,620.00 | 2.11 |
| 19 | 002179 | 中航光电 | 39,000 | 1,689,480.00 | 2.08 |
| 20 | 300097 | 智云股份 | 33,300 | 1,666,665.00 | 2.05 |
| 21 | 300114 | 中航电测 | 50,000 | 1,490,000.00 | 1.83 |
| 22 | 300457 | 赢合科技 | 19,000 | 1,470,790.00 | 1.81 |
| 23 | 300198 | 纳川股份 | 90,000 | 1,448,100.00 | 1.78 |
| 24 | 300373 | 扬杰科技 | 60,000 | 1,446,600.00 | 1.78 |
| 25 | 002245 | 澳洋顺昌 | 110,000 | 1,404,700.00 | 1.73 |
| 26 | 002460 | 赣锋锂业 | 30,000 | 1,003,500.00 | 1.24 |
| 27 | 600303 | 曙光股份 | 50,000 | 742,500.00 | 0.91 |
| 28 | 002569 | 步森股份 | 20,000 | 711,600.00 | 0.88 |
| 29 | 600562 | 国睿科技 | 20,400 | 699,516.00 | 0.86 |
| 30 | 002049 | 紫光国芯 | 15,500 | 681,225.00 | 0.84 |
| 31 | 600667 | 太极实业 | 31,000 | 309,690.00 | 0.38 |
| 32 | 300012 | 华测检测 | 10,000 | 123,800.00 | 0.15 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 33 | 600990 | 四创电子 | 1,000 | 86,690.00 | 0.11 |
| 34 | 002466 | 天齐锂业 | 1,000 | 42,690.00 | 0.05 |
| 35 | 603005 | 晶方科技 | 1,000 | 37,870.00 | 0.05 |
| 36 | 300127 | 银河磁体 | 1,000 | 25,480.00 | 0.03 |
| 37 | 300036 | 超图软件 | 1,000 | 24,500.00 | 0.03 |
| 38 | 300474 | 景嘉微 | 100 | 15,087.00 | 0.02 |
| 39 | 300484 | 蓝海华腾 | 100 | 11,670.00 | 0.01 |
| 40 | 002777 | 久远银海 | 4 | 484.00 | — |

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

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 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 002355 | 兴民钢圈 | 7,581,126.00 | 0.96 |
| 2 | 002284 | 亚太股份 | 6,333,321.00 | 0.80 |
| 3 | 002273 | 水晶光电 | 5,388,231.25 | 0.68 |
| 4 | 300188 | 美亚柏科 | 5,221,068.32 | 0.66 |
| 5 | 002709 | 天赐材料 | 5,214,975.07 | 0.66 |
| 6 | 000687 | 华讯方舟 | 4,673,782.04 | 0.59 |
| 7 | 002048 | 宁波华翔 | 4,281,060.00 | 0.54 |
| 8 | 002108 | 沧州明珠 | 3,991,681.00 | 0.50 |
| 9 | 300065 | 海兰信 | 3,789,778.00 | 0.48 |
| 10 | 002407 | 多氟多 | 3,598,310.00 | 0.46 |
| 11 | 300351 | 永贵电器 | 3,525,488.00 | 0.45 |
| 12 | 300248 | 新开普 | 3,489,985.00 | 0.44 |
| 13 | 002285 | 世联行 | 3,469,627.00 | 0.44 |
| 14 | 300073 | 当升科技 | 3,444,649.00 | 0.44 |
| 15 | 000988 | 华工科技 | 3,368,407.00 | 0.43 |
| 16 | 000960 | 锡业股份 | 3,339,700.00 | 0.42 |
| 17 | 600756 | 浪潮软件 | 3,180,592.00 | 0.40 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 18 | 600136 | 当代明诚 | 3,152,950.00 | 0.40 |
| 19 | 002590 | 万安科技 | 3,062,554.00 | 0.39 |
| 20 | 300297 | 蓝盾股份 | 3,039,030.00 | 0.38 |

注：“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。

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

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 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 002273 | 水晶光电 | 5,631,316.00 | 0.71 |
| 2 | 300188 | 美亚柏科 | 4,688,680.00 | 0.59 |
| 3 | 002355 | 兴民钢圈 | 4,281,738.00 | 0.54 |
| 4 | 000687 | 华讯方舟 | 4,104,188.82 | 0.52 |
| 5 | 002284 | 亚太股份 | 3,630,315.00 | 0.46 |
| 6 | 000960 | 锡业股份 | 3,531,677.00 | 0.45 |
| 7 | 002285 | 世联行 | 3,494,869.97 | 0.44 |
| 8 | 300065 | 海兰信 | 3,449,854.00 | 0.44 |
| 9 | 000988 | 华工科技 | 3,448,010.00 | 0.44 |
| 10 | 600446 | 金证股份 | 3,285,368.00 | 0.42 |
| 11 | 300248 | 新开普 | 3,186,530.00 | 0.40 |
| 12 | 300297 | 蓝盾股份 | 3,161,951.61 | 0.40 |
| 13 | 002709 | 天赐材料 | 3,157,400.00 | 0.40 |
| 14 | 300036 | 超图软件 | 2,911,190.00 | 0.37 |
| 15 | 600756 | 浪潮软件 | 2,860,351.99 | 0.36 |
| 16 | 002664 | 信质电机 | 2,831,574.38 | 0.36 |
| 17 | 600730 | 中国高科 | 2,798,078.00 | 0.35 |
| 18 | 600136 | 当代明诚 | 2,696,416.00 | 0.34 |
| 19 | 300324 | 旋极信息 | 2,411,266.00 | 0.30 |
| 20 | 002564 | 天沃科技 | 2,409,500.00 | 0.30 |

注：“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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 285,041,946.44 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 228,046,719.28 |

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。

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

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。

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 | 81,781.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | 953,938.87 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 1,385.68 |
| 5 | 应收申购款 | 1,839,945.64 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 2,877,052.13 |

7.12.4 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。

7.12.5 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 | 002781 | 奇信股份 | 8,867,025.75 | 10.92 | 老股转让 |
| 2 | 300488 | 恒锋工具 | 5,230,722.12 | 6.44 | 重大资产重组 |
| 3 | 300351 | 永贵电器 | 3,053,700.00 | 3.76 | 非公开发行股份 |

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

| 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 |
| 9,509 | 5,946.78 | 7,738,565.13 | 13.68% | 48,809,329.42 | 86.32% |

8.2 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 | 4,012.82 | 0.01% |

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 | 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 |

注：1、基金管理人高级管理人员、基金投资和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 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 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 606,321,031.54 |
| 本报告期基金总申购份额 | 107,858,983.62 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 657,632,120.61 |

| | |
|--------------|---------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 56,547,894.55 |

注：总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 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。

本报告期内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稽查或处罚等情况

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

10.7.1 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 | 占当期股票成交总额比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 安信证券 | 1 | 87,150,634.63 | 16.99% | 63,733.29 | 14% | — |
| 广发证券 | 2 | 261,726,874.71 | 51.01% | 243,746.07 | 53.53% | — |
| 海通证券 | 1 | 15,825,238.79 | 3.08% | 14,738.16 | 3.24% | — |
| 申银万国 | 1 | 88,160,581.87 | 17.18% | 82,104.04 | 18.03% | — |
| 银河证券 | 1 | 5,724,162 | 1.12% | 5,330.91 | 1.17% | — |
| 中金公司 | 1 | 25,872,653 | 5.04% | 24,094.91 | 5.29% | — |
| 中投证券 | 1 | 25,435,223.72 | 4.96% | 18,600.84 | 4.09% | — |
| 中信证券 | 1 | 3,193,297 | 0.62% | 2,973.91 | 0.65% | — |

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、在上述租用的券商交易单元中，28704（中投证券）、396770（中投证券）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。

10.7.2 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 | 占当期债券成交总额比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额比例 |
| 安信证券 | — | — | — | — | — | — |
| 广发证券 | — | — | — | — | — | — |
| 海通证券 | — | — | — | — | — | — |
| 申银万国 | — | — | — | — | — | — |
| 银河证券 | — | — | 700,000,000 | 100% | — | — |
| 中金公司 | — | — | — | — | — | — |
| 中投证券 | — | — | — | — | — | — |
| 中信证券 | — | — | — | — | — | — |

10.8 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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-07 |
| 4 | 富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-20 |
| 5 | 富安达基金管理有限公司关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告 | 公司网站 | 2016-01-22 |
| 6 | 富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-08 |
| 9 | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-17 |
| 10 | 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股份有限公司个人电子银行基金申购费 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-26 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------|
| | 率优惠的公告 | | |
| 11 | 富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告摘要 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-03-26 |
| 12 | 富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》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费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-11 |
| 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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-16 |
| 17 | 富安达新兴成长招募说明书（更新）（二〇一六年第一号） | 公司网站 | 2016-04-23 |
| 18 | 富安达新兴成长招募说明书（更新）（二〇一六年第一号）摘要 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-23 |
| 19 | 富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-04-22 |
| 20 | 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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-11 |
| 21 | 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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 | 2016-06-06 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------|
| | 份有限公司为代销机构及开通定投和转换业务的公告 | 和公司网站 | |
| 22 | 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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-18 |
| 23 | 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 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-29 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《富安达新兴成长灵活配置混合型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

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

二〇一六年八月二十六日