

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

2016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：2017年3月27日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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2017年3月23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2016年01月01日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	60,697,947.83
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	蒋晓刚	陆志俊
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	luzj@bankcomm.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	2016年	2015年	2014年9月11日 -2014年12月31日
本期已实现收益	-13,728,184.37	59,240,935.35	-3,497,051.04
本期利润	-25,890,016.12	67,744,164.49	-317,614.04
加权平均基金份额本期利润	-0.3033	0.0618	-0.0016
本期基金份额净值增长率	-20.38%	37.40%	-5.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0095	0.1987	-0.0510

期末基金资产净值	63,016,816.92	790,589,353.59	99,345,079.26
期末基金份额净值	1.0382	1.3039	0.9490

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	-12.48%	1.20%	-1.97%	0.49%	-10.51%	0.71%
过去六个月	-27.72%	1.27%	0.52%	0.54%	-28.24%	0.73%
过去一年	-20.38%	1.89%	-10.16%	1.04%	-10.22%	0.85%
自基金合同生效日起至今（2014年09月11日-2016年12月31日）	3.82%	1.56%	23.53%	1.35%	-19.71%	0.21%

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：

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

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

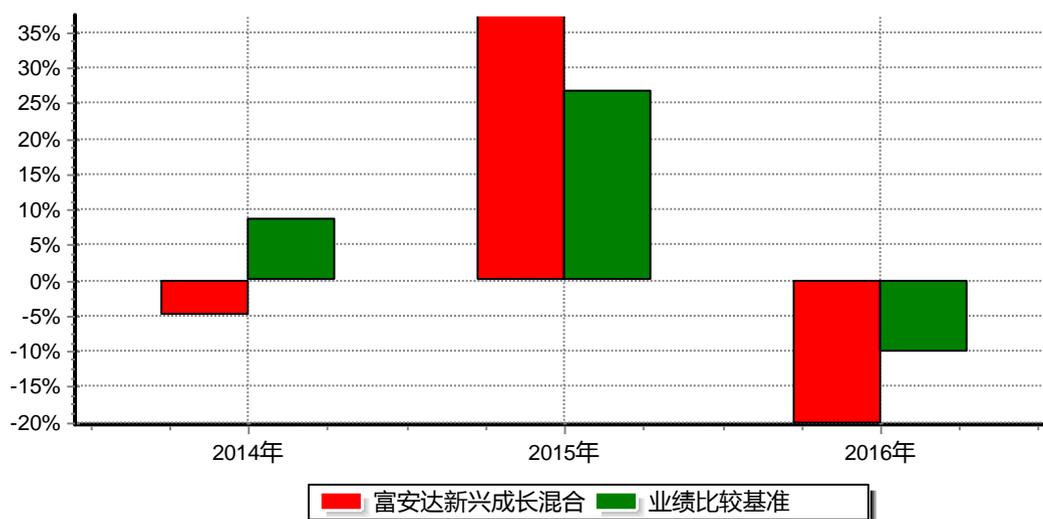
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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。

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2016年12月31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、富安达新动力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		
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	硕士。历任齐鲁证券研究所行业研究员。2011年1月加入富安达基金管理有限公司任高级行业研究员兼基金经理助理。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达新兴成长灵活配置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》。

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。

4.3.3 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

报告期内，受去杠杆、汇率贬值、美国加息等因素影响，全年市场指数均以下跌收盘，其中主板跌幅好于中小创业板，市场总体呈低位震荡格局。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：上半年，我们积极布局战略新兴产业，在市场深度调整阶段，我们加大了对新能源汽车产业链等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，取得了较好的投资回报；下半年，在市场风格发生转变之机，我们一方面继续坚守估值合理、安全边际较高的个股；另一方面也紧跟市场风格，减仓了前期获利较多的行业板块，加大了对周期性行业的配置，同时着眼2017年，加大了对油气、化工、军工等行业板块的配置。但在市场风格纷杂且多变背景下，下半年基金净值仍受到了一定的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为1.0382元，本报告期份额净值增长率为-20.38%，同期业绩比较基准收益率为-10.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面：一方面虽然受工业企业补库存等因素影响，宏观经济短期企稳，但我们认为经济增长动力的持续性仍不乐观；另一方面防风险、抑泡沫仍是2017年的主要基调，流动性风险仍不可忽视；此外，特朗普上台为中美关系带来的不确定性及欧洲走向也需要重视。从基本面看，让宏观经济重新焕发生机仍是当前的重要课题，宏观经济预计未来一段时间宏观经济将呈现L型弱平衡的运行态势。但从微观企业的表现看，随着改革的深化，尽管宏观增长动力不足,但结构性的增长亮点也会层出不穷。

中央经济工作会议定调2017年为供给侧改革深化之年，行业配置方面，我们将积极关注政策深化带来的相关主题机会，比如混改；同时着眼布局制造业复苏带来的投资机会。对于新能源汽车、电子信息等新兴产业，2017年仍有配置良机，我们依旧密切跟踪。

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

2016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2016年12月31日的资产负债表、2016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。注册会计师陈玲、都晓燕于2017年3月23日签字出具了普华永道中天审字(2017)第21987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：2016年12月31日

单位：人民币元

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	1,938,373.02	96,187.07
结算备付金		13,257,488.77	767,942,796.64
存出保证金		92,852.69	47,180.60
交易性金融资产	7.4.7.2	50,182,204.80	22,981,281.62
其中: 股票投资		50,182,204.80	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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		2,414,455.89	1,743,430.14
应收利息	7.4.7.5	5,133.41	279,460.67
应收股利		—	—
应收申购款		52,318.74	42,688.67
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		67,942,827.32	793,133,025.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		3,065,471.97	—
应付赎回款		585,813.82	84,419.64

应付管理人报酬		86,357.09	1,522,540.79
应付托管费		14,392.88	253,756.80
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	712,965.49	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	7.4.7.8	461,009.15	410,072.72
负债合计		4,926,010.40	2,543,671.82
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	60,697,947.83	606,321,031.54
未分配利润	7.4.7.10	2,318,869.09	184,268,322.05
所有者权益合计		63,016,816.92	790,589,353.59
负债和所有者权益总计		67,942,827.32	793,133,025.41

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.0382元，基金份额总额60,697,947.83份。

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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
一、收入		-21,352,461.04	93,374,190.23
1.利息收入		1,180,144.41	18,900,519.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	702,988.12	15,179,848.50
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

买入返售金融资产收入		477,156.29	3,720,671.02
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,348,758.59	62,436,668.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-12,497,507.89	62,149,885.69
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	148,749.30	286,782.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-12,161,831.75	8,503,229.14
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	1,977,984.89	3,533,773.25
减：二、费用		4,537,555.08	25,630,025.74
1. 管理人报酬		1,642,435.43	20,904,986.55
2. 托管费		273,739.24	3,484,164.54
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.19	2,174,920.41	853,229.65
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	446,460.00	387,645.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-25,890,016.12	67,744,164.49
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”		-25,890,016.12	67,744,164.49

号填列)			
------	--	--	--

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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016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)	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)	—	-25,890,016.12	-25,890,016.12
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)	-545,623,083.71	-156,059,436.84	-701,682,520.55
其中：1.基金申购款	174,594,364.82	60,241,979.81	234,836,344.63
2.基金赎回款	-720,217,448.53	-216,301,416.65	-936,518,865.18
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)	60,697,947.83	2,318,869.09	63,016,816.92
项 目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	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)	—	67,744,164.49	67,744,164.49
三、本期基金份额交易产生的	501,641,871.15	121,858,238.69	623,500,109.84

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	1,856,653,721.03	501,047,813.82	2,357,701,534.85
2.基金赎回款	-1,355,011,849.88	-379,189,575.13	-1,734,201,425.01
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)	606,321,031.54	184,268,322.05	790,589,353.59

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

蒋晓刚

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]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。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%,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2017年3月23日批准报出。

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7.4.4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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、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政策的补充通知》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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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。

7.4.7 关联方关系

7.4.7.1 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。

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
南京证券股份有限公司	—	—	18,985,781.28	3.70%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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
南京证券	—	—	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
南京证券	17,284.73	3.68%		—

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,642,435.43	20,904,986.55
其中：支付销售机构的客户维护费	392,797.48	13,722,762.67

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月
----	--------------------------	-------------------------------

	31日	31日
当期发生的基金应支付的托管费	273,739.24	3,484,164.54

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 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	12.75%	7,738,565.13	1.28%

7.4.8.5 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1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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 存款	1,938,373.02	33,259.54	96,187.07	4,002,718.49

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。

7.4.8.6 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的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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
002509	天广中茂	2016-09-21	重大事项	12.68		—	110,000	1,377,100.00	1,394,800.00
002664	信质电机	2016-12-16	重大资产重组	25.39		—	100	2,670.00	2,539.00
300100	双林股份	2016-11-07	重大资产重组	34.00	2017-01-25	30.60	32,900	1,112,591.58	1,118,600.00
300189	神农基因	2016-12-12	重大资产重组	5.25	2017-02-28	5.34	10,000	52,800.00	52,500.00
300450	先导智能	2016-11-15	重大资产重组	31.21	2017-02-08	33.00	149,000	4,940,044.94	4,650,290.00

注：本基金截至2016年12月31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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度可比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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度可比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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为42,963,475.80元，属于第二层次的余额为7,218,729.00元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次6,826,754.17元，第二层次16,154,527.45元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，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	50,182,204.80	73.86
	其中：股票	50,182,204.80	73.86
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	15,195,861.79	22.37
7	其他各项资产	2,564,760.73	3.77
8	合计	67,942,827.32	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	52,500.00	0.08
B	采矿业	10,753,349.00	17.06

C	制造业	36,889,831.00	58.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,406,924.00	3.82
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	360.80	—
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	—	—
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	79,240.00	0.13
S	综合	—	—
	合计	50,182,204.80	79.63

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	300450	先导智能	149,000	4,650,290.00	7.38
2	002048	宁波华翔	176,100	3,898,854.00	6.19
3	000655	金岭矿业	320,000	3,030,400.00	4.81
4	002013	中航机电	150,000	2,743,500.00	4.35
5	300164	通源石油	254,800	2,634,632.00	4.18
6	002648	卫星石化	210,000	2,566,200.00	4.07
7	300237	美晨科技	144,300	2,406,924.00	3.82
8	600685	中船防务	80,000	2,376,000.00	3.77

9	002353	杰瑞股份	115,100	2,336,530.00	3.71
10	002064	华峰氨纶	400,000	2,196,000.00	3.48

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	300073	当升科技	11,358,287.00	1.44
2	002460	赣锋锂业	11,335,384.00	1.43
3	002709	天赐材料	10,237,471.07	1.29
4	600547	山东黄金	10,025,527.00	1.27
5	002355	兴民智通	9,516,326.00	1.20
6	300037	新宙邦	8,741,559.22	1.11
7	002048	宁波华翔	8,391,453.00	1.06
8	002284	亚太股份	8,342,556.00	1.06
9	002108	沧州明珠	8,093,496.75	1.02
10	600104	上汽集团	7,777,650.00	0.98
11	601689	拓普集团	7,243,308.00	0.92
12	600072	钢构工程	7,206,711.00	0.91
13	002245	澳洋顺昌	6,852,221.00	0.87
14	603026	石大胜华	6,780,129.00	0.86
15	300210	森远股份	6,140,427.00	0.78
16	300188	美亚柏科	5,965,068.32	0.75
17	002716	金贵银业	5,689,535.00	0.72
18	000065	北方国际	5,656,126.73	0.72
19	300100	双林股份	5,644,711.69	0.71
20	000070	特发信息	5,601,500.00	0.71

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	300073	当升科技	11,085,348.40	1.40
2	002709	天赐材料	10,694,780.50	1.35
3	002460	赣锋锂业	10,408,836.00	1.32
4	600547	山东黄金	9,543,257.18	1.21
5	300037	新宙邦	8,560,117.00	1.08
6	002355	兴民智通	8,325,714.99	1.05
7	002108	沧州明珠	8,168,692.50	1.03
8	002284	亚太股份	8,080,528.00	1.02
9	600104	上汽集团	7,802,090.00	0.99
10	601689	拓普集团	7,019,210.00	0.89
11	002781	奇信股份	6,845,282.60	0.87
12	600072	钢构工程	6,662,500.00	0.84
13	603026	石大胜华	6,382,514.00	0.81
14	002245	澳洋顺昌	6,337,768.75	0.80
15	300488	恒锋工具	5,780,321.16	0.73
16	002273	水晶光电	5,633,595.00	0.71
17	002716	金贵银业	5,471,948.00	0.69
18	000070	特发信息	5,450,927.00	0.69
19	600498	烽火通信	5,433,285.80	0.69
20	300188	美亚柏科	5,410,785.00	0.68

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	779,070,382.41
卖出股票的收入（成交）总额	727,210,119.59

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。

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，基金投资的前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内除美晨科技（300237）外，没有受到公开谴责、处罚。

山东美晨科技股份有限公司（以下简称“美晨科技”）于2016年7月15日收到中国证券监督管理委员会山东监管局（以下简称“山东证监局”）对美晨科技下发的《关于对山东美晨科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》（【2016】31号），就美晨科技的内幕信息知情人登记管理制度、内幕信息知情人登记制度的不规范问题提出了整改要求。

2016年8月25日，美晨科技发布公告表示已对上述问题进行整改，目前处于整改完毕并持续规范阶段。

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下，经公司审慎研究评估，将该股票纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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	92,852.69
2	应收证券清算款	2,414,455.89
3	应收股利	—
4	应收利息	5,133.41
5	应收申购款	52,318.74
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,564,760.73

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	300450	先导智能	4,650,290.00	7.38	重大资产重组

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
7,983	7,603.4	7,738,565.13	12.75%	52,959,382.70	87.25%

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	7.76	—

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

注：1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0。
2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

§ 10 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	174,594,364.82
减：本报告期基金总赎回份额	720,217,448.53
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	60,697,947.83

§ 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：

2016年1月9日，富安达基金管理有限公司发布公告，增聘吴战峰为富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理。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。

2016年1月30日，富安达基金管理有限公司发布公告，解聘孔学兵为富安达优势成长混合型证券投资基金基金经理。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。

2016年7月22日，富安达基金管理有限公司发布公告，增聘张凯瑜为富安达长盈保本混合型证券投资基金基金经理。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。

2016年12月10日，富安达基金管理有限公司发布《关于富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金清算报告的公告》，李飞、张凯瑜不再担任富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理。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。

2016年12月17日，富安达基金管理有限公司发布公告，解聘毛矛为富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金经理，增聘纪青为富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金经理。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，免去孔学兵同志职工董事职务，同意金领千同志为富安达基金管理有限公司第二届职工董事。本议案提交股东会审议通过，并上报中国证监会。

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12月29日以通讯方式召开2016年第二次股东会，本次会议应到股东代表3名，实到股东代表3名，代表公司表决权总数的100%。会议决议聘请张敏同志为公司股东董事，王旭同志不再担任公司股东董事职务。本议案已上报中国证监会。

2017年1月16日，富安达基金管理有限公司发布《关于副总经理离任的公告》，朱龙芳因退休原因离任富安达基金管理有限公司副总经理一职。高级管理人员变更事项已

按规定报中国证监会上海监管局及中国基金业协会备案。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

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)。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为100,000元人民币。

截至本报告期末,该事务所已向本基金提供3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。

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	
安信证券	1	181,140,712.50	12.03%	132,468.28	10.08%	
光大证券	1	34,633,267.53	2.30%	32,253.99	2.45%	
广发证券	2	261,726,874.71	17.38%	243,746.07	18.55%	
国信证券	1	175,484,017.34	11.65%	128,332.00	9.77%	

海通证券	1	15,825,238.79	1.05%	14,738.16	1.12%	
华创证券	1	299,910,772.34	19.91%	279,307.26	21.25%	
申万宏源	2	137,569,192.87	9.13%	128,118.35	9.75%	
西藏东财	1	61,513,472.66	4.08%	44,984.49	3.42%	
兴业证券	1	13,678,730.00	0.91%	12,738.90	0.97%	
银河证券	1	68,152,129.61	4.52%	63,470.00	4.83%	
中金公司	1	33,241,601.00	2.21%	30,957.62	2.36%	
中投证券	1	25,435,223.72	1.69%	18,600.84	1.42%	
中信证券	2	197,969,268.93	13.14%	184,368.48	14.03%	

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，28704（中国中投）、396770（中国中投）、36284（国信证券）、001461（国信证券）、35734（国海证券）、001212（国海证券）、36680（西藏东财）、001680（西藏东财）、36878（华龙证券）、002031（华龙证券）、37464（长江证券）、002740（长江证券）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。

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
安信证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
西藏东财	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	700,000,000.00	100.00%	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中投证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

富安达基金管理有限公司

二〇一七年三月二十七日