

**富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告摘要**

**2017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：2017年8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、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2017年8月22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2017年01月01日起至06月30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	51,225,642.16
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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-1,621,365.54
本期利润	6,389,893.04
加权平均基金份额本期利润	0.1123
本期基金份额净值增长率	11.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0382
期末基金资产净值	59,104,998.51
期末基金份额净值	1.1538

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	11.67%	1.25%	5.02%	0.46%	6.65%	0.79%
过去三个月	4.82%	1.56%	1.05%	0.49%	3.77%	1.07%
过去六个月	11.13%	1.31%	2.96%	0.45%	8.17%	0.86%
过去一年	-19.67%	1.30%	3.50%	0.50%	-23.17%	0.80%
自基金合同生效日起至今（2014年09月11日-2017年06月30日）	15.38%	1.52%	27.18%	1.24%	-11.80%	0.28%

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

富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2014年9月11日-2017年6月30日）



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2017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	2015年5月22日	—	10年	硕士。历任齐鲁证券研究所行业研究员。2011年1

	经理、公司研究发展部总监助理			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

报告期内宏观经济好于预期，虽然地产限购升级，汽车消费受政策退坡影响略显低

迷，经济复苏不确定依然存在，但经济表现出极强的韧性。报告期内，虽有美元加息扰动，但特朗普效应逐步消退，美元走弱，人民币贬值压力缓解。国内防风险、去杠杆仍是主旋律，自二季度起，监管趋严，流动性偏紧，资本市场承压，风险偏好降低，追求业绩的确定性达到极致，市场结构化行情明显，白马蓝筹受到市场追捧，上证50表现尤其突出。

投资策略方面：我们加强了行业趋势研究和公司调研，提高了对行业龙头、长期看好标的配置。考虑到当前瞬息万变的市场风格，我们认为唯有把握确定性才是跑赢基准的有效策略。一方面，我们着眼行业未来的确定性机会，加大了对新能源汽车产业链和消费电子等行业板块的配置；另一方面，紧跟市场节奏把握投资机会，阶段性的配置了一带一路、军工等主题板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本基金份额净值为1.1538元，本报告期份额净值增长率为11.13%，同期业绩比较基准收益率为2.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着上游原材料和中游制造业景气度往下游传导，中下游企业的盈利有望回升，宏观经济展现出较好的韧性，但考虑到宏观经济增长的新动力仍有待培育，预计下半年宏观经济将维持L型走势。从微观企业的表现看，随着改革的深化，我们认为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。

预计A股也将维持震荡格局，市场呈现结构性机会。当前，稳定的政策和流动性环境背景下，我们认为市场没有深度下跌的基础，蓝筹板块短期积累过多涨幅之后反而有利于资金向景气板块轮动。下半年仍有较好的结构性投资机会，优选业绩增速和估值合理的标的，把握确定性仍是本基金的主要目标。

#### 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**

2017年度上半年，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**

2017年度上半年，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**

2017年度上半年，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半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：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,614.42	1,938,373.02
结算备付金		4,789,414.21	13,257,488.77
存出保证金		114,777.00	92,852.69
交易性金融资产	6.4.7.2	56,140,330.92	50,182,204.80
其中：股票投资		56,140,330.92	50,182,204.80
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		93,492.06	2,414,455.89
应收利息	6.4.7.5	2,044.63	5,133.41
应收股利		—	—
应收申购款		251,781.40	52,318.74
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		61,412,454.64	67,942,827.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		711,277.07	3,065,471.97
应付赎回款		823,714.57	585,813.82

应付管理人报酬		72,216.38	86,357.09
应付托管费		12,036.03	14,392.88
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	383,503.49	712,965.49
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	304,708.59	461,009.15
负债合计		2,307,456.13	4,926,010.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	51,225,642.16	60,697,947.83
未分配利润	6.4.7.10	7,879,356.35	2,318,869.09
所有者权益合计		59,104,998.51	63,016,816.92
负债和所有者权益总计		61,412,454.64	67,942,827.32

注：1、报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.1538元，基金份额总额51,225,642.16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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入		8,142,482.72	-115,711.35
1.利息收入		52,256.04	1,120,514.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	52,256.04	643,357.83
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
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-55,820.49	-8,798,292.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-253,728.21	-8,909,574.53
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	197,907.72	111,282.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,011,258.58	5,995,835.62
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	134,788.59	1,566,231.30
<b>减：二、费用</b>		1,752,589.68	2,186,960.66
1. 管理人报酬		454,372.37	1,056,822.08
2. 托管费		75,728.71	176,137.04
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.19	1,110,492.52	728,884.93
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	111,996.08	225,116.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,389,893.04	-2,302,672.01
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		6,389,893.04	-2,302,672.01

号填列)			
------	--	--	--

### 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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017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)	60,697,947.83	2,318,869.09	63,016,816.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	6,389,893.04	6,389,893.04
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)	-9,472,305.67	-829,405.78	-10,301,711.45
其中：1.基金申购款	21,173,817.80	1,815,836.65	22,989,654.45
2.基金赎回款	-30,646,123.47	-2,645,242.43	-33,291,365.90
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)	51,225,642.16	7,879,356.35	59,104,998.51
项 目	上年度可比期间 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

“-”号填列)			
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	-657,632,120.61	-199,303,269.09	-856,935,389.70
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

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

沈伟青

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×60%+中债总指数收益率×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8月24日批准报出。

#### 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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6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 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) [适用于2016年5月1日前成立的基金]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，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
富安达基金管理有限公司("富安达基金")	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
南京市河西新城区国有资产经营控股	基金管理人的股东

(集团) 有限责任公司 (" 南京河西 ")	
富安达资产管理 (上海) 有限公司 ("富安达资管")	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

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本基金本报告期及上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。

#### 6.4.8.1.4 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.5 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 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

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	454,372.37	1,056,822.08
其中：支付销售机构的客户维护费	184,855.48	585,333.41

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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	75,728.71	176,137.04

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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

#### 6.4.8.4 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

注：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。

##### 6.4.8.4.2 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		上年度末	
	2017年6月30日		2016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	15.11%	7,738,565.13	12.75%

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
交通银行活期存款	20,614.42	5,789.03	6,207,050.52	17,214.02

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2017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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

#### 6.4.8.7 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。

### 6.4.9 期末（2017年6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

注：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
002127	南极电商	2017-06-29	重大资产重组	12.08	2017-07-06	12.61	90,000	1,136,700.00	1,087,200.00
300100	双林股份	2017-04-05	重大资产重组	25.96		—	30,776	862,357.45	798,944.96

注：本基金截至2017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。

#### 6.4.9.3 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。

### 6.4.9.3.2 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。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	56,140,330.92	91.42
	其中：股票	56,140,330.92	91.42
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	4,810,028.63	7.83
7	其他各项资产	462,095.09	0.75
8	合计	61,412,454.64	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	52,336,998.12	88.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,699,136.00	4.57
E	建筑业	—	—
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	13,560.00	0.02
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,087,200.00	1.84
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	3,436.80	0.01
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	56,140,330.92	94.98

### 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

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	300450	先导智能	112,400	5,818,948.00	9.85
2	002460	赣锋锂业	124,000	5,735,000.00	9.70
3	002466	天齐锂业	105,000	5,706,750.00	9.66
4	002635	安洁科技	139,500	5,052,690.00	8.55
5	603799	华友钴业	72,000	4,376,160.00	7.40
6	002384	东山精密	151,000	3,729,700.00	6.31
7	300073	当升科技	138,600	3,456,684.00	5.85
8	002241	歌尔股份	160,542	3,095,249.76	5.24
9	600487	亨通光电	100,000	2,805,000.00	4.75
10	300335	迪森股份	140,800	2,699,136.00	4.57

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半年度报告正文。

### 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	603799	华友钴业	14,579,186.00	23.14
2	300073	当升科技	11,078,457.72	17.58
3	002460	赣锋锂业	8,818,888.00	13.99
4	000050	深天马 A	8,470,238.00	13.44
5	600760	中航黑豹	7,999,533.00	12.69

6	000333	美的集团	7,434,000.00	11.80
7	002497	雅化集团	7,176,239.83	11.39
8	002236	大华股份	6,845,178.00	10.86
9	300340	科恒股份	6,749,880.60	10.71
10	600068	葛洲坝	6,345,200.00	10.07
11	002466	天齐锂业	6,194,392.49	9.83
12	002456	欧菲光	6,191,338.00	9.82
13	600884	杉杉股份	6,185,772.00	9.82
14	600161	天坛生物	5,688,126.00	9.03
15	000980	众泰汽车	5,673,955.00	9.00
16	600487	亨通光电	5,579,900.00	8.85
17	002635	安洁科技	5,385,189.00	8.55
18	600967	内蒙一机	5,187,240.00	8.23
19	600038	中直股份	5,154,205.32	8.18
20	600072	中船科技	5,034,521.00	7.99
21	600104	上汽集团	4,879,600.00	7.74
22	002008	大族激光	4,740,858.00	7.52
23	300450	先导智能	4,719,230.00	7.49
24	002127	南极电商	4,332,865.00	6.88
25	000049	德赛电池	4,252,484.00	6.75
26	600456	宝钛股份	4,215,757.00	6.69
27	000065	北方国际	4,214,364.00	6.69
28	002709	天赐材料	4,180,447.94	6.63
29	000801	四川九洲	3,992,500.00	6.34
30	000921	海信科龙	3,873,374.00	6.15
31	002384	东山精密	3,708,969.00	5.89
32	300100	双林股份	3,587,520.00	5.69
33	002051	中工国际	3,518,500.00	5.58
34	000768	中航飞机	3,507,330.00	5.57
35	000418	小天鹅 A	3,338,809.20	5.30

36	600316	洪都航空	3,335,700.00	5.29
37	002156	通富微电	3,120,400.00	4.95
38	601633	长城汽车	3,078,288.00	4.88
39	300335	迪森股份	2,957,426.00	4.69
40	000820	神雾节能	2,951,096.00	4.68
41	600547	山东黄金	2,890,780.00	4.59
42	300433	蓝思科技	2,829,311.20	4.49
43	002241	歌尔股份	2,779,396.42	4.41
44	600000	浦发银行	2,763,800.00	4.39
45	300070	碧水源	2,747,380.00	4.36
46	600176	中国巨石	2,744,960.00	4.36
47	002074	国轩高科	2,736,212.95	4.34
48	002043	兔宝宝	2,684,200.00	4.26
49	600426	华鲁恒升	2,683,900.00	4.26
50	002636	金安国纪	2,655,913.00	4.21
51	600970	中材国际	2,631,900.00	4.18
52	300136	信维通信	2,615,260.00	4.15
53	002475	立讯精密	2,538,248.80	4.03
54	300219	鸿利智汇	2,537,700.00	4.03
55	600685	中船防务	2,516,480.00	3.99
56	600183	生益科技	2,474,385.20	3.93
57	600584	长电科技	2,456,500.00	3.90
58	002307	北新路桥	2,422,000.00	3.84
59	601117	中国化学	2,421,000.00	3.84
60	000786	北新建材	2,412,500.00	3.83
61	000951	中国重汽	2,403,323.00	3.81
62	600477	杭萧钢构	2,341,810.00	3.72
63	600343	航天动力	2,330,242.00	3.70
64	600066	宇通客车	2,277,353.50	3.61
65	002271	东方雨虹	2,260,000.00	3.59

66	600782	新钢股份	2,215,000.00	3.51
67	300197	铁汉生态	2,198,903.00	3.49
68	300146	汤臣倍健	2,182,339.85	3.46
69	002427	尤夫股份	2,162,835.00	3.43
70	300408	三环集团	2,157,025.13	3.42
71	000498	山东路桥	2,143,986.00	3.40
72	600809	山西汾酒	2,135,012.00	3.39
73	000823	超声电子	2,087,100.00	3.31
74	002110	三钢闽光	2,067,069.00	3.28
75	002007	华兰生物	2,006,600.00	3.18
76	002624	完美世界	1,967,500.00	3.12
77	600110	诺德股份	1,957,977.00	3.11
78	600436	片仔癀	1,952,051.00	3.10
79	002340	格林美	1,934,000.00	3.07
80	000915	山大华特	1,898,000.00	3.01
81	002192	融捷股份	1,894,840.00	3.01
82	002283	天润曲轴	1,881,197.60	2.99
83	600885	宏发股份	1,875,920.00	2.98
84	600677	航天通信	1,859,855.00	2.95
85	600166	福田汽车	1,761,500.00	2.80
86	300497	富祥股份	1,691,652.76	2.68
87	300122	智飞生物	1,684,344.00	2.67
88	601166	兴业银行	1,639,881.00	2.60
89	002179	中航光电	1,639,508.00	2.60
90	601965	中国汽研	1,631,377.00	2.59
91	600871	石化油服	1,592,000.00	2.53
92	300116	坚瑞沃能	1,580,600.00	2.51
93	002555	三七互娱	1,502,200.00	2.38
94	002543	万和电气	1,495,764.00	2.37
95	002716	金贵银业	1,427,000.00	2.26

96	002355	兴民智通	1,391,900.00	2.21
97	002148	北纬通信	1,326,500.00	2.10
98	300034	钢研高纳	1,326,000.00	2.10

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。

#### 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	603799	华友钴业	10,908,773.00	17.31
2	600760	中航黑豹	9,853,413.00	15.64
3	000050	深天马 A	8,101,893.00	12.86
4	000333	美的集团	7,642,614.00	12.13
5	300073	当升科技	7,563,201.00	12.00
6	002236	大华股份	6,996,418.00	11.10
7	600038	中直股份	6,690,602.75	10.62
8	002497	雅化集团	6,454,262.12	10.24
9	600967	内蒙一机	6,384,400.00	10.13
10	600068	葛洲坝	6,214,000.00	9.86
11	600884	杉杉股份	6,107,438.00	9.69
12	300450	先导智能	5,767,618.00	9.15
13	300340	科恒股份	5,750,730.00	9.13
14	000980	众泰汽车	5,682,056.00	9.02
15	600072	中船科技	5,266,600.20	8.36
16	600685	中船防务	5,075,780.00	8.05
17	600104	上汽集团	5,048,800.00	8.01
18	600161	天坛生物	4,980,358.00	7.90
19	002460	赣锋锂业	4,938,143.00	7.84
20	002048	宁波华翔	4,672,552.50	7.41
21	000768	中航飞机	4,639,512.00	7.36
22	000049	德赛电池	4,331,661.17	6.87

23	000065	北方国际	4,301,822.00	6.83
24	600456	宝钛股份	4,145,156.00	6.58
25	002709	天赐材料	4,062,371.00	6.45
26	000801	四川九洲	3,926,943.00	6.23
27	002456	欧菲光	3,789,317.50	6.01
28	000418	小天鹅 A	3,554,735.00	5.64
29	300100	双林股份	3,526,368.08	5.60
30	002353	杰瑞股份	3,492,213.00	5.54
31	002051	中工国际	3,464,376.11	5.50
32	000655	金岭矿业	3,451,241.05	5.48
33	000921	海信科龙	3,358,292.00	5.33
34	600316	洪都航空	3,300,910.67	5.24
35	002127	南极电商	3,153,018.00	5.00
36	601633	长城汽车	3,084,560.00	4.89
37	002013	中航机电	3,047,817.00	4.84
38	002156	通富微电	3,015,701.02	4.79
39	300164	通源石油	3,004,545.62	4.77
40	600176	中国巨石	2,999,303.00	4.76
41	600487	亨通光电	2,969,400.00	4.71
42	300237	美晨科技	2,915,536.00	4.63
43	002064	华峰氨纶	2,856,510.00	4.53
44	000820	神雾节能	2,854,829.00	4.53
45	600547	山东黄金	2,850,510.00	4.52
46	002307	北新路桥	2,831,520.00	4.49
47	002008	大族激光	2,827,000.00	4.49
48	002636	金安国纪	2,817,020.00	4.47
49	300070	碧水源	2,770,084.00	4.40
50	000951	中国重汽	2,725,823.00	4.33
51	002648	卫星石化	2,712,347.86	4.30
52	600426	华鲁恒升	2,708,600.00	4.30

53	600000	浦发银行	2,708,000.00	4.30
54	600970	中材国际	2,689,898.00	4.27
55	002074	国轩高科	2,670,377.21	4.24
56	300433	蓝思科技	2,644,480.00	4.20
57	002475	立讯精密	2,616,572.40	4.15
58	002043	兔宝宝	2,556,000.00	4.06
59	600183	生益科技	2,438,480.60	3.87
60	002271	东方雨虹	2,414,534.00	3.83
61	600477	杭萧钢构	2,411,688.96	3.83
62	601117	中国化学	2,411,166.00	3.83
63	300219	鸿利智汇	2,379,348.00	3.78
64	600759	洲际油气	2,365,408.00	3.75
65	600584	长电科技	2,362,378.00	3.75
66	000786	北新建材	2,359,563.00	3.74
67	600343	航天动力	2,307,314.00	3.66
68	600066	宇通客车	2,220,800.00	3.52
69	000498	山东路桥	2,179,900.00	3.46
70	600782	新钢股份	2,176,000.00	3.45
71	300197	铁汉生态	2,124,605.66	3.37
72	002427	尤夫股份	2,102,699.00	3.34
73	600436	片仔癀	2,043,657.00	3.24
74	300408	三环集团	2,041,500.00	3.24
75	000901	航天科技	2,038,251.00	3.23
76	600809	山西汾酒	2,019,420.88	3.20
77	600110	诺德股份	2,009,131.00	3.19
78	002554	惠博普	2,005,288.00	3.18
79	002007	华兰生物	1,993,663.00	3.16
80	300084	海默科技	1,981,483.38	3.14
81	002624	完美世界	1,962,906.00	3.11
82	000823	超声电子	1,959,069.00	3.11

83	002110	三钢闽光	1,940,000.00	3.08
84	600150	中国船舶	1,931,937.00	3.07
85	000915	山大华特	1,895,128.00	3.01
86	002466	天齐锂业	1,882,561.00	2.99
87	002340	格林美	1,864,500.00	2.96
88	600885	宏发股份	1,859,285.00	2.95
89	002283	天润曲轴	1,816,469.55	2.88
90	600960	渤海活塞	1,792,718.54	2.84
91	600677	航天通信	1,789,200.00	2.84
92	002192	融捷股份	1,787,272.00	2.84
93	600166	福田汽车	1,776,000.00	2.82
94	300122	智飞生物	1,761,821.84	2.80
95	300497	富祥股份	1,744,735.00	2.77
96	300210	森远股份	1,703,552.00	2.70
97	601166	兴业银行	1,681,000.00	2.67
98	002179	中航光电	1,670,630.00	2.65
99	002635	安洁科技	1,654,974.00	2.63
100	601965	中国汽研	1,643,279.63	2.61
101	600871	石化油服	1,570,000.00	2.49
102	002555	三七互娱	1,469,285.00	2.33
103	300116	坚瑞沃能	1,468,704.00	2.33
104	002543	万和电气	1,449,023.00	2.30
105	002509	天广中茂	1,442,054.00	2.29
106	002716	金贵银业	1,397,200.00	2.22
107	002148	北纬通信	1,334,424.00	2.12
108	002355	兴民智通	1,319,500.00	2.09
109	300034	钢研高纳	1,279,500.00	2.03
110	600889	南京化纤	1,271,033.00	2.02

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。

#### 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	384,549,170.51
卖出股票的收入（成交）总额	386,348,574.76

“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

注：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

注：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前十名资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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 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，在报告编制日前一年内除赣锋锂业（002460）外，没有受到公开谴责、处罚。

赣锋锂业2016年11月4日发布《关于全资子公司美拜电子意外起火爆炸事件的进展公告》，其全资子公司美拜电子收到龙华新区安全生产监察部门《行政处罚决定书》（深

宝龙安监管罚【2016】龙07101号、深宝龙安监管罚【2016】龙01702号),深圳市宝安区安全生产监督管理局龙华新区安全生产监察部门决定对美拜电子处以22万元罚款,对其法定代表人李万春处以9万元罚款。

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。

7.12.2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。

### 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	114,777.00
2	应收证券清算款	93,492.06
3	应收股利	—
4	应收利息	2,044.63
5	应收申购款	251,781.40
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	462,095.09

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

注:本基金本报告期期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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

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
6,755	7,583.37	7,738,565.13	15.11%	43,487,077.03	84.89%

**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	7.76	—

**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、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0。  
2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

**§ 9 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	60,697,947.83
本报告期基金总申购份额	21,173,817.80
减：本报告期基金总赎回份额	30,646,123.47
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	51,225,642.16

**§ 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：

2017年1月16日，基金管理人发布《富安达基金管理有限公司关于副总经理离任的公告》，朱龙芳女士因已届法定退休年龄离任公司副总经理。

2017年2月23日，基金管理人在公司召开职工董事人选举大会，选举吴战峰先生代表公司全体职工担任富安达基金管理有限公司董事会职工董事。职工董事变更事项已上报中国证监会。

2017年3月23日，基金管理人发布《富安达基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》，公司聘任沈伟青先生为副总经理。

2017年4月21日，基金管理人因原独立董事赵曙明、陈良华、马维勇任职期届满，在南京召开2016年度股东会，选举赵顺龙、刘健、江涛为公司第三届董事会独立董事。独立董事变更事项已上报中国证监会。

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。

## 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	
广发证券	1	4,415,290	0.57%	4,111.98	0.63%	—
国海证券	1	41,389,500.8	5.37%	30,268.01	4.62%	—
国泰君安	1	92,364,609.96	11.98%	86,019.34	13.12%	—
华创证券	1	236,065,002.46	30.62%	219,847.13	33.53%	—
西藏东财	1	27,852,880	3.61%	20,368.68	3.11%	—
中金公司	1	89,908,167.99	11.66%	83,731.47	12.77%	—
中投证券	1	241,648,521.56	31.35%	176,717.45	26.95%	—
中信证券	1	37,253,772.5	4.83%	34,694.36	5.29%	—

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，（003133）华金证券、（38262）华金证券、（003441）信达证券、（48045）中泰证券、（390511）中泰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 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

富安达基金管理有限公司

二〇一七年八月二十四日