

**富安达新动力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1月1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	富安达新动力混合
基金主代码	001659
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月7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	53,456,323.68
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，深入研究并积极投资于以科技进步、产业创新和转型升级等经济发展新动力驱动的高速成长企业，充分把握新经济周期下科技进步、产业创新和转型升级所带来的投资机会，在有效控制风险的前提下，力争为投资者带来长期稳定的超额收益。
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。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以科技进步、产业创新和转型升级等经济发展新动力驱动的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，本基金将对相关证券资产的配置比例做出适时调整。
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
	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

## 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	9,765,663.98
本期利润	16,262,861.97
加权平均基金份额本期利润	0.1302
本期基金份额净值增长率	16.09%
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	0.1023

期末基金资产净值	62,141,933.61
期末基金份额净值	1.1625

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	8.31%	0.72%	5.02%	0.46%	3.29%	0.26%
过去三个月	9.83%	0.64%	1.05%	0.49%	8.78%	0.15%
过去六个月	16.09%	0.52%	2.96%	0.45%	13.13%	0.07%
自基金合同生效日起至今（2016年12月07日-2017年06月30日）	16.25%	0.49%	0.09%	0.48%	16.16%	0.01%

注：①本基金业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%，

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：

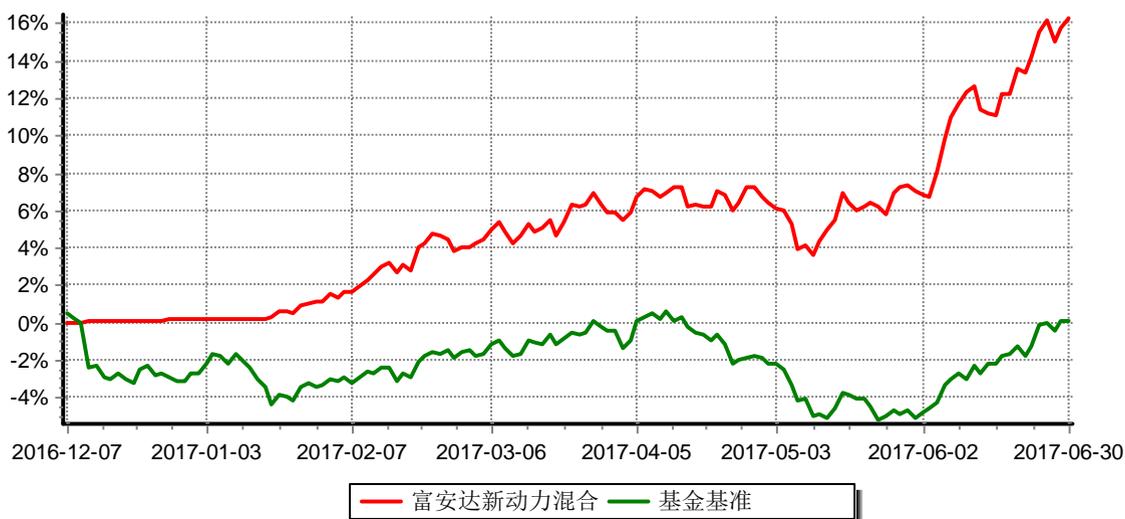
$$\text{Return } t = 60\% \times [\text{中证新兴产业指数}t / \text{中证新兴产业指数}(t-1) - 1] + 40\% \times [\text{中债总指数}t / \text{中债总指数}(t-1) - 1]$$

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

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

富安达新动力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  
 （2016年12月7日-2017年6月30日）



注：根据《富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2017年6月7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06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		
毛矛	本基金	2016年12月	—	13年	硕士。历任中华资源（香

	的基金 经理	7日		港)有限公司交易员;易唯思商务咨询有限公司投资分析师;光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2012年4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。2015年5月起任富安达策略精选灵活配置混合型基金、富安达健康人生灵活配置混合型基金的基金经理(2015年11月25日至2016年12月17日期间)、富安达新动力灵活配置混合型基金的基金经理。
--	-----------	----	--	--

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》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达新动力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

回顾2017年上半年，市场仍然呈现出显著的结构分化，以大盘蓝筹为主上证50、沪深300指数上涨超过10%，而小盘指数中证500、中证1000则下跌；新动力上半年的收益为16.09%，超越了比较基准。资产配置方面，新动力在二季度逐渐增加了权益类配置；行业配置方面，新动力大幅增加了金融行业的配置，在二季度末增加了部分周期性行业的配置，对部分前期上涨速度较快的个股进行了减持；固定收益类证券基本没有配置。

##### 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1.1625元，本报告期份额净值增长率为16.09%，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

2017年上半年经济总体稳中有升，GDP增速、工业增加值等较去年下半年有所上升，我们认为主要原因是地产成交仍然保持较高水平带动地产投资有一定回升，另外大宗商品的价格处于较高水平也带动了重资产周期类行业的生产。中期来看，我们预计经济增长仍然会比较稳定，虽然地产成交及价格有一定回落，但仍不致对投资产生较大压制。股市方面，上半年蓝筹和中小盘表现差异较大，我们预计在利率没有形成下降趋势前，存量博弈导致市场的结构性分化仍将延续，但未来蓝筹中也有可能出现分化，而中小盘中少部分优质公司的股价也可能有较好表现。

#### 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动力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动力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动力灵活配置混合型证券投资基金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：富安达新动力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	32,809.57	250,845,499.07
结算备付金		8,382,178.41	—
存出保证金		66,034.87	—
交易性金融资产	6.4.7.2	54,317,087.37	—
其中：股票投资		54,317,087.37	—
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	—	100,000,000.00
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	3,434.89	842,548.32
应收股利		—	—
应收申购款		14,048.34	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		62,815,593.45	351,688,047.39
<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		61,535.85	—

应付赎回款		306,373.45	—
应付管理人报酬		80,052.47	345,229.52
应付托管费		13,342.05	57,538.26
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	94,685.45	76.84
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	117,670.57	40,000.00
负债合计		673,659.84	442,844.62
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	53,456,323.68	350,747,173.59
未分配利润	6.4.7.10	8,685,609.93	498,029.18
所有者权益合计		62,141,933.61	351,245,202.77
负债和所有者权益总计		62,815,593.45	351,688,047.39

注：1、本基金合同生效日为2016年12月7日，2016年度实际报告期间为2016年12月7日至2016年12月31日。

2、本报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.1625元，基金份额总额53,456,323.68份。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达新动力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
一、收入		18,152,100.57
1.利息收入		1,098,643.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	621,965.40
债券利息收入		49,644.66
资产支持证券利息收入		—

买入返售金融资产收入		427,033.88
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,488,527.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,031,687.24
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	-42,388.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—
股利收益	6.4.7.16	499,229.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,497,197.99
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	1,067,730.68
<b>减：二、费用</b>		1,889,238.60
1. 管理人报酬		989,754.75
2. 托管费		164,959.09
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.19	602,791.71
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	131,733.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,262,861.97
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		16,262,861.97

号填列)

注：本基金合同生效日为2016年12月7日，无上年度可比期间。

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：富安达新动力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)	350,747,173.59	498,029.18	351,245,202.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	16,262,861.97	16,262,861.97
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)	-297,290,849.91	-8,075,281.22	-305,366,131.13
其中：1.基金申购款	2,422,609.04	174,605.47	2,597,214.51
2.基金赎回款	-299,713,458.95	-8,249,886.69	-307,963,345.64
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)	53,456,323.68	8,685,609.93	62,141,933.61

注：本基金合同生效日为2016年12月7日，无上年度可比期间。

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

富安达新动力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[2015]1475号《关于准予富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《富安达富安达新动力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350703184.13元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2016)第1610号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为350747173.59份基金份额,其中认购资金利息折合43,989.46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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达新动力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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、资产支持证券、中小企业私募债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

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%,其中投资于新动力主题相关的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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》、《富安达新动力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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款

项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵

销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

### 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("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：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易业务。

**6.4.8.1.2 权证交易**

注：本基金本报告期内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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有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。

**6.4.8.1.5 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
南京证券	250,000,000.00	14.53%

## 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
当期发生的基金应支付的管理费	989,754.75
其中：支付销售机构的客户维护费	455,868.34

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 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	164,959.09

注：1.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

### 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	
	期末余额	当期利息收入
交通银行活期存款	32,809.57	43,746.02
交通银行定期存款	—	64,222.21

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(2016年6月30日：同)。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：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

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	54,317,087.37	86.47
	其中：股票	54,317,087.37	86.47
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	8,414,987.98	13.40
7	其他各项资产	83,518.10	0.13
8	合计	62,815,593.45	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	3,350,890.88	5.39
B	采矿业	3,399,521.00	5.47
C	制造业	26,365,896.90	42.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	721,744.00	1.16
E	建筑业	615,648.00	0.99
F	批发和零售业	1,233,859.25	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	1,302,386.93	2.10
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	825,507.20	1.33
J	金融业	12,310,963.19	19.81
K	房地产业	876,402.00	1.41
L	租赁和商务服务业	645,426.56	1.04
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	2,531,193.30	4.07
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	137,648.16	0.22
S	综合	—	—
	合计	54,317,087.37	87.41

**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	000651	格力电器	107,353	4,419,723.01	7.11
2	601318	中国平安	80,500	3,993,605.00	6.43
3	002714	牧原股份	123,104	3,350,890.88	5.39
4	600054	黄山旅游	148,023	2,531,193.30	4.07
5	000858	五粮液	42,524	2,366,885.84	3.81
6	601601	中国太保	69,774	2,363,245.38	3.80
7	601288	农业银行	659,900	2,322,848.00	3.74
8	601988	中国银行	619,600	2,292,520.00	3.69
9	600104	上汽集团	56,960	1,768,608.00	2.85
10	600486	扬农化工	32,610	1,376,468.10	2.22

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	000418	小天鹅 A	6,617,056.60	1.88
2	601318	中国平安	6,273,832.00	1.79
3	002714	牧原股份	5,591,240.08	1.59
4	000157	中联重科	4,840,557.00	1.38
5	600521	华海药业	4,637,274.04	1.32
6	002078	太阳纸业	4,433,404.00	1.26
7	000630	铜陵有色	4,403,858.00	1.25
8	000651	格力电器	4,212,697.00	1.20
9	600584	长电科技	3,961,172.00	1.13

10	000858	五 粮 液	3,707,956.00	1.06
11	600690	青岛海尔	3,698,087.00	1.05
12	601211	国泰君安	3,622,083.00	1.03
13	000333	美的集团	3,600,632.00	1.03
14	300199	翰宇药业	3,496,101.00	1.00
15	601088	中国神华	3,469,956.00	0.99
16	002589	瑞康医药	3,376,384.21	0.96
17	300180	华峰超纤	3,349,375.00	0.95
18	601998	中信银行	3,306,090.00	0.94
19	601601	中国太保	3,096,889.00	0.88
20	600104	上汽集团	3,095,613.00	0.88

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	000418	小天鹅 A	7,435,167.94	2.12
2	002078	太阳纸业	4,678,599.16	1.33
3	600690	青岛海尔	4,669,390.65	1.33
4	000630	铜陵有色	4,528,809.85	1.29
5	000157	中联重科	3,912,411.63	1.11
6	601992	金隅股份	3,899,562.85	1.11
7	601088	中国神华	3,885,561.03	1.11
8	002589	瑞康医药	3,841,791.64	1.09
9	601318	中国平安	3,836,361.46	1.09
10	000333	美的集团	3,711,851.20	1.06
11	601211	国泰君安	3,688,020.86	1.05
12	300199	翰宇药业	3,645,526.37	1.04
13	600521	华海药业	3,578,571.13	1.02
14	300180	华峰超纤	3,421,389.47	0.97

15	000488	晨鸣纸业	3,415,902.38	0.97
16	002564	天沃科技	3,270,951.34	0.93
17	601998	中信银行	3,248,365.95	0.92
18	300233	金城医药	3,196,474.90	0.91
19	000980	众泰汽车	3,061,556.58	0.87
20	600308	华泰股份	2,748,003.06	0.78

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	232,933,994.10
卖出股票的收入（成交）总额	194,145,791.96

“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，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	66,034.87
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,434.89
5	应收申购款	14,048.34
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	83,518.10

**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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

**§ 8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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
1,006	53,137.50	543,753.26	1.02%	52,912,570.42	98.98%

**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	1,922.52	0.004%

**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(2016年12月7日)基金份额总额	350,747,173.59
本报告期期初基金份额总额	350,747,173.59
本报告期基金总申购份额	2,422,609.04
减：本报告期基金总赎回份额	299,713,458.95
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	53,456,323.68

**§ 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

本报告期内无涉及本基金管理人、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，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。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	25,777,370.62	6.04%	18,850.73	5.08%	—
广发证券	1	102,879,432.87	24.09%	95,812.06	25.84%	—
国金证券	1	90,904,506.17	21.29%	84,659.37	22.83%	—
国信证券	1	108,718,918.79	25.46%	79,506.6	21.44%	—
海通证券	1	66,864,874.6	15.66%	62,271.18	16.8%	—
南京证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	1	31,854,877.34	7.46%	29,666.67	8%	—

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。

### 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	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	726,000,000	42.18%	—	—
海通证券	2,509,504.8	100%	733,000,000	42.59%	—	—
南京证券	—	—	250,000,000	14.53%	—	—
申万宏源	—	—	12,000,000	0.7%	—	—

## § 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：本报告期间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