

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

2017 年年度报告摘要

2017 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:2018 年 03 月 31 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 2018 年 3 月 28 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 2017 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	富安达健康人生混合
基金主代码	001861
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月25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	66,645,850.86份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过资产的灵活配置,重点投资于能够满足人们对优质健康生活需求的上市公司,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健康人生主题下的上市公司证券,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	沪深 300 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	沈伟青	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	2017年	2016年	2015-11-25 (基金合同生效日) -2015年12月31日
本期已实现收益	7,662,469.80	-1,288,018.32	-33,194.14
本期利润	19,504,362.13	-1,577,520.22	48,585.54
加权平均基金份额本期利润	0.1440	-0.0063	0.0001
本期基金份额净值增长率	16.56%	-1.80%	0.01%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利	0.0850	-0.0179	0.0000

润			
期末基金资产净值	76,289,315.52	161,391,720.44	319,701,202.39
期末基金份额净值	1.1447	0.9821	1.0001

- 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	9.34%	1.10%	2.70%	0.48%	6.64%	0.62%
过去六个月	12.70%	0.87%	5.69%	0.42%	7.01%	0.45%
过去一年	16.56%	0.74%	12.15%	0.39%	4.41%	0.35%
自基金合同生效起至今	14.47%	0.74%	6.13%	0.68%	8.34%	0.06%

注：①本基金业绩比较基准为：60%×沪深300指数+40%×中债总财富总指数，

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：

$$\text{Return}_t = 60\% \times [\text{沪深300指数}_t / \text{沪深300指数}(t-1) - 1] + 40\% \times [\text{中债总财富总指数}_t / \text{中债总财富总指数}(t-1) - 1]$$

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

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

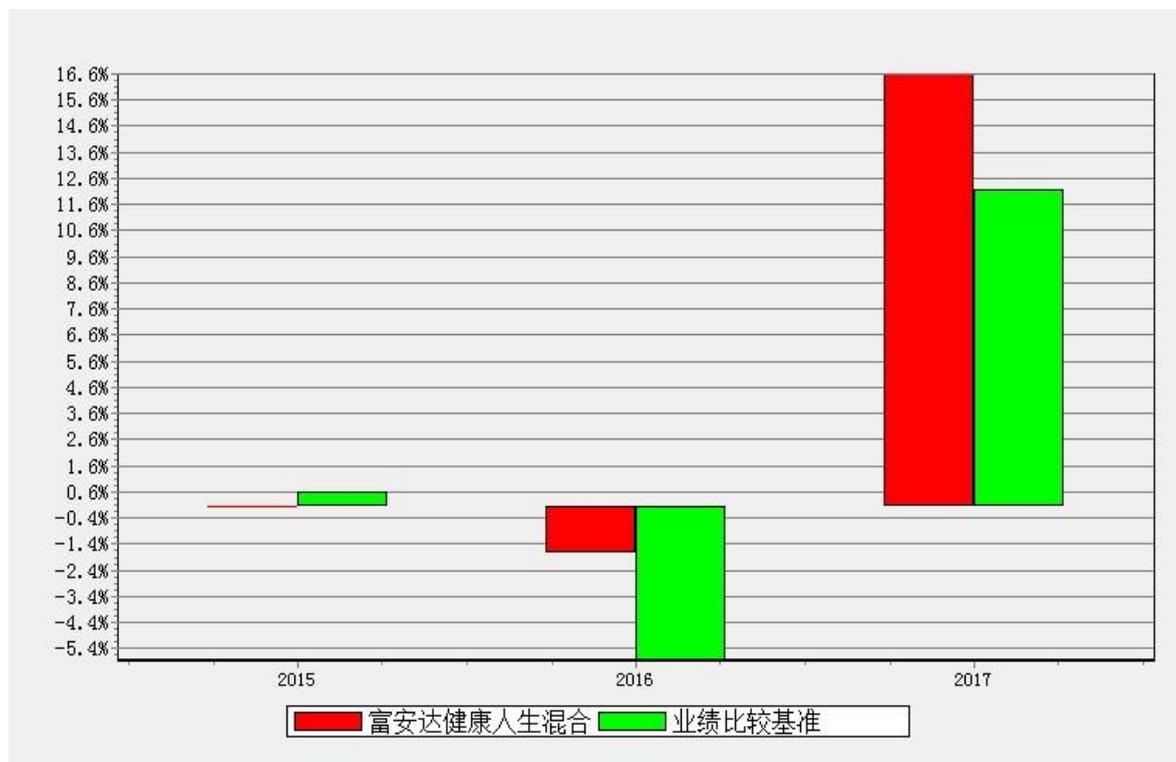
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年11月25日-2017年12月31日)



根据《富安达健康人生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2016年5月24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



本基金合同于2015年11月25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2017年12月31日，公司共管理9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

资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题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		
李守峰	本基金的 基金经理	2015-12- 25	-	7年	博士。历任万联证券研究所医药研究员。2013年3月加入富安达基金管理有限公司任行业研究员。
纪青	本基金的 基金经理	2016-12- 16	-	9年	硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。2013年4月加入富安达基金管理有限公司任高级金融工程研究员。

1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达健康人生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，本基金不存在异常交易行为。

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

2017年是行情巨大分化的一年，上证综指全年上涨6.56%，深证成指上涨8.48%，中小板指数上涨16.73%，创业板指数下跌10.67%；按照市值大小构建的几个规模指数的走势分化非常明显，其中上证50和沪深300全年分别上涨了25.08%和21.77%，中证1000跌幅为17.35%。分行业来看，以食品饮料和家用电器为代表的消费类板块表现突出，纺织服装、计算机和传媒板块全年跌幅较大。年初我们持仓的重点仍放在医药行业上，但随着一季报及中报的公布，部分医药子行业如医药商业出现了基本面恶化的迹象，部分持仓个股业绩低于市场预期，上半年我们将这些基本面出现恶化的持仓调整出组合，增持了医药股中景气度较高的生长激素相关上市公司、增持了创新药相关标的，在医药行业以外，我们布局了景气度较高的奶制品行业及光伏产业链相关上市公司，另外，我们也相对看好处于盈利好转“前夜”的航空龙头，对相关标的进行了配置。四季度中央办公厅、国务院办公厅印发了《关于深化审评审批制度改革鼓励药品医疗器械创新的意见》，创新药获政策扶持，相关标的的表现净值的上涨做出了一定贡献，光伏、航空等行业的表现也验证了我们的判断。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金份额净值为1.1447元；本报告期内，基金份额净值增长率为16.56%，同期业绩比较基准收益率为12.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年，我们认为宏观经济在供给侧改革背景下总体将继续保持平稳，仍处于“L”型的一横中，CPI较17年将有所回升。证券市场方面，与17年只有大市值股票上涨的极端行情不同，我们预计18年大市值股票将有所分化，小市值成长股在经历了去年的调整后今年将有部分个股有所表现，核心影响因素是估值和盈利增速的匹配程度。我们投资的重点放在健康最相关的医药行业上，我们认为，医药行业经过近三年的调整，估值

已经处于历史均值以下，政策面已经逐步接近底部了，一些利好因素可能会逐步推进，比如进一步鼓励创新等，另外，经过仿制药一致性评价的优胜劣汰后，龙头企业的竞争环境将好于之前。我们也将积极寻找其它处于景气周期向上的行业，力争为投资者贡献收益。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.9 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，基金托管人在富安达健康人生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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017年度，富安达基金管理有限公司在富安达健康人生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

2017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健康人生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）审计了富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"富安达健康人生混合基金")的财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表，2017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。注册会计师薛竞、陈熹于 2017 年 3 月 29日签字出具了普华永道中天审字(2018)第21849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：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,639,939.67	50,917.01
结算备付金		210,452.54	20,666,239.68
存出保证金		62,645.38	150,944.56

交易性金融资产	7.4.7.2	71,340,533.84	117,475,588.43
其中：股票投资		67,346,533.84	117,475,588.43
基金投资		-	-
债券投资		3,994,000.00	-
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	3,000,000.00	24,000,000.00
应收证券清算款		1,144,616.29	-
应收利息	7.4.7.5	88,812.28	22,454.30
应收股利		-	-
应收申购款		7,795.77	531.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		80,494,795.77	162,366,675.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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		3,452,240.10	-
应付赎回款		258,994.61	-
应付管理人报酬		115,626.36	224,259.60
应付托管费		19,271.08	37,376.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	129,345.56	623,319.30
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	230,002.54	90,000.00
负债合计		4,205,480.25	974,955.49
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	66,645,850.86	164,329,107.39
未分配利润	7.4.7.1 0	9,643,464.66	-2,937,386.95
所有者权益合计		76,289,315.52	161,391,720.44
负债和所有者权益总计		80,494,795.77	162,366,675.93

报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.1447元，基金份额总额66,645,850.86份。

7.2 利润表

会计主体：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间2016年12月31日至2016年12月31日
一、收入		23,688,755.77	5,553,646.56
1. 利息收入		839,970.86	1,732,171.26
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	304,211.12	910,098.61
债券利息收入		42,066.85	31.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		493,692.89	822,041.09
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,816,441.34	3,834,490.85
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	9,603,395.51	2,960,026.28

基金投资收益	7.4.7.1 3	-	-
债券投资收益	7.4.7.1 4	3,877.32	18,760.44
资产支持证券投资收 益	7.4.7.1 4.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.1 5	-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 6	-	-
股利收益	7.4.7.1 7	1,209,168.51	855,704.13
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.1 8	11,841,892.33	-289,501.90
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.1 9	190,451.24	276,486.35
减：二、费用		4,184,393.64	7,131,166.78
1. 管理人报酬	7.4.8. 2.1	2,069,994.93	3,759,384.37
2. 托管费	7.4.8. 2.2	344,999.16	626,563.99
3. 销售服务费	7.4.8. 2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.2 0	1,432,614.55	2,580,093.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.2 1	336,785.00	165,125.00
三、利润总额(亏损总额以“-”		19,504,362.13	-1,577,520.22

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		19,504,362.13	-1,577,520.22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日至2017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)	164,329,107.39	-2,937,386.95	161,391,720.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,504,362.13	19,504,362.13
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)	-97,683,256.53	-6,923,510.52	-104,606,767.05
其中：1. 基金申购款	42,223,106.52	982,336.76	43,205,443.28
2. 基金赎回款	-139,906,363.05	-7,905,847.28	-147,812,210.33
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)	66,645,850.86	9,643,464.66	76,289,315.52

项 目	上年度可比期间 2016年12月31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)	319,676,389.81	24,812.58	319,701,202.39

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,577,520.22	-1,577,520.22
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)	-155,347,282.42	-1,384,679.31	-156,731,961.73
其中：1. 基金申购款	5,451,549.88	-61,255.99	5,390,293.89
2. 基金赎回款	-160,798,832.30	-1,323,423.32	-162,122,255.62
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)	164,329,107.39	-2,937,386.95	161,391,720.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富安达健康人生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]2041号《关于准予富安达健康人生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《富安达健康人生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359,240,820.11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(2015)第1324号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达健康人生灵和配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年11月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为359,287,506.07份基金份额,其中认购资金利息折合46,685.96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《富安达健康人生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、股指期货及法律法规或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)。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%,其中投资于健康人生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,持有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:沪深300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2018年3月29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》、《富安达健康人生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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017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2017年12月31日的财务状况以及2017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

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 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，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

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 (“富安达基金”)	基金管理人、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

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 2017年01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月31日至2016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	32,723,930.10	3.37%	94,155,842.20	5.31%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017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	30,475.	3.69%	30,475.87	23.56%

	87			
关联方名称	上年度可比期间 2016年12月31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	87,687.32	5.53%	12,314.51	1.98%

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。

7.4.8.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月31日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
南京证券	2,547,393.15	26.39%	-	-

7.4.8.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年12月31日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
南京证券	33,000,000.00	2.44%	-	-

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 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月31日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,069,994.93	3,759,384.37
其中：支付销售机构的客户维护费	933,859.23	1,866,169.37

1. 支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 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 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月31日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	344,999.16	626,563.99

支付基金托管人交通银行的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发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期

	2017年01月01 日至2017年12 月31日	间 2016年12月31 日至2016年12 月31日
基金合同生效日（2015年11月25日）持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
报告期初持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	9,999,000.00	-
报告期末持有的基金份额	-	9,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	6.08%

1. 期间赎回总份额含转换出份额。

2. 基金管理人在本年度赎回本基金的交易委托直销柜台办理，无赎回费。

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 2017年12月31日		上年度末 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
南京证券	0.00	0.00%	4,999,00 0.00	3.04%
富安达资管	10,616,7 05.01	15.93%	0.00	0.00%

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 2017年01月01日至2017年12 月31日		上年度可比期间 2016年12月31日至2016年12月3 1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	4,639,939.67	17,539.64	50,917.01	260,275.32
交通银行定期存款	0.00	0.00	-	48,000.00

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行约定利率计息。

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（2017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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	20,000	633,168.00	642,800.00	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

本基金截至2017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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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2017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66,674,785.38元，属于第二层次的余额为4,665,748.46元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次98,189,913.97元，第二层次19,285,674.46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或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)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2017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(2016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) 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，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。

根据财政部、国家税务总局于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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营

资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金2017年12月31日的财务状况和2017年度的经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	67,346,533.84	83.67
	其中：股票	67,346,533.84	83.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,994,000.00	4.96
	其中：债券	3,994,000.00	4.96
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,000,000.00	3.73
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,850,392.21	6.03
8	其他各项资产	1,303,869.72	1.62
9	合计	80,494,795.77	100.00

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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

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	37,797,155.84	49.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	6,169,078.00	8.09
G	交通运输、仓储和邮政业	9,759,200.00	12.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,382,000.00	3.12
K	房地产业	5,115,500.00	6.71
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	6,123,600.00	8.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	67,346,533.84	88.28

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	000661	长春高新	40,000	7,320,000.00	9.60
2	600029	南方航空	550,000	6,556,000.00	8.59
3	002773	康弘药业	100,300	6,186,504.00	8.11
4	002044	美年健康	280,000	6,123,600.00	8.03
5	600521	华海药业	200,000	6,024,000.00	7.90
6	000671	阳光城	650,000	5,115,500.00	6.71
7	600867	通化东宝	172,042	3,938,041.30	5.16

				8	
8	002024	苏宁云商	300,000	3,687,000.00	4.83
9	000910	大亚圣象	160,000	3,664,000.00	4.80
10	601111	中国国航	260,000	3,203,200.00	4.20

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	601111	中国国航	9,003,161.00	5.58
2	600594	益佰制药	8,814,668.55	5.46
3	000661	长春高新	8,727,796.88	5.41
4	600511	国药股份	7,566,855.00	4.69
5	000538	云南白药	7,548,649.08	4.68
6	002332	仙琚制药	7,513,508.66	4.66
7	600085	同仁堂	7,246,744.82	4.49
8	600572	康恩贝	6,956,883.56	4.31
9	600420	现代制药	6,902,804.93	4.28
10	600887	伊利股份	6,547,157.00	4.06
11	002024	苏宁易购	6,382,000.00	3.95
12	600029	南方航空	6,139,100.00	3.80
13	600030	中信证券	6,047,400.00	3.75
14	601988	中国银行	5,784,000.00	3.58
15	600557	康缘药业	5,775,363.00	3.58
16	002773	康弘药业	5,729,908.00	3.55
17	601901	方正证券	5,596,088.04	3.47

18	600585	海螺水泥	5,540,187.75	3.43
19	002044	美年健康	5,301,267.00	3.28
20	000546	金圆股份	5,278,144.00	3.27
21	600436	片仔癀	5,190,253.64	3.22
22	601318	中国平安	5,072,880.83	3.14
23	600998	九州通	5,036,764.00	3.12
24	600115	东方航空	5,004,700.00	3.10
25	600285	羚锐制药	4,910,711.00	3.04
26	600867	通化东宝	4,783,517.36	2.96
27	600406	国电南瑞	4,642,200.00	2.88
28	600332	白云山	4,626,596.00	2.87
29	600062	华润双鹤	4,501,718.00	2.79
30	600521	华海药业	4,404,669.70	2.73
31	002223	鱼跃医疗	4,360,704.00	2.70
32	000671	阳光城	4,348,000.00	2.69
33	300347	泰格医药	4,334,511.12	2.69
34	000756	新华制药	4,286,552.00	2.66
35	600176	中国巨石	4,245,507.32	2.63
36	000705	浙江震元	4,202,187.00	2.60
37	600056	中国医药	4,188,897.00	2.60
38	600886	国投电力	4,141,000.00	2.57
39	002758	华通医药	4,076,640.02	2.53
40	001979	招商蛇口	4,006,800.00	2.48
41	601288	农业银行	3,997,000.00	2.48
42	002020	京新药业	3,985,804.00	2.47
43	600048	保利地产	3,982,938.00	2.47
44	600161	天坛生物	3,971,929.24	2.46
45	600267	海正药业	3,946,115.00	2.45
46	300003	乐普医疗	3,921,983.00	2.43
47	600718	东软集团	3,892,774.00	2.41
48	601607	上海医药	3,882,800.00	2.41

49	600702	舍得酒业	3,868,572.00	2.40
50	600438	通威股份	3,860,500.00	2.39
51	600036	招商银行	3,849,016.00	2.38
52	300274	阳光电源	3,593,700.00	2.23
53	000910	大亚圣象	3,584,036.00	2.22
54	000069	华侨城 A	3,548,422.00	2.20
55	002159	三特索道	3,490,616.00	2.16
56	002242	九阳股份	3,488,574.00	2.16
57	000739	普洛药业	3,233,500.00	2.00

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	300123	亚光科技	13,363,105.95	8.28
2	002589	瑞康医药	12,949,952.74	8.02
3	002462	嘉事堂	9,218,681.02	5.71
4	600887	伊利股份	9,041,148.07	5.60
5	600594	益佰制药	8,444,306.00	5.23
6	002004	华邦健康	8,160,222.67	5.06
7	600867	通化东宝	8,129,271.88	5.04
8	002094	青岛金王	7,539,807.00	4.67
9	601111	中国国航	7,507,233.00	4.65
10	600085	同仁堂	7,429,389.00	4.60
11	002332	仙琚制药	7,284,744.94	4.51
12	600572	康恩贝	7,252,948.82	4.49
13	002626	金达威	6,789,840.95	4.21
14	600511	国药股份	6,748,294.00	4.18
15	300091	金通灵	6,747,000.00	4.18
16	000590	启迪古汉	6,746,829.22	4.18
17	600420	现代制药	6,628,971.52	4.11
18	000546	金圆股份	6,388,901.00	3.96

19	000028	国药一致	6,379,193.00	3.95
20	600030	中信证券	6,232,839.00	3.86
21	600585	海螺水泥	6,179,600.00	3.83
22	600079	人福医药	6,129,416.00	3.80
23	601901	方正证券	6,108,897.55	3.79
24	600436	片仔癀	5,912,856.00	3.66
25	300273	和佳股份	5,835,334.00	3.62
26	000661	长春高新	5,711,899.10	3.54
27	600557	康缘药业	5,661,613.00	3.51
28	601318	中国平安	5,599,341.95	3.47
29	000538	云南白药	5,467,648.00	3.39
30	600115	东方航空	5,084,962.00	3.15
31	600285	羚锐制药	5,059,419.30	3.13
32	300097	智云股份	4,920,025.00	3.05
33	600062	华润双鹤	4,880,604.00	3.02
34	600176	中国巨石	4,834,510.20	3.00
35	600998	九州通	4,705,843.00	2.92
36	002223	鱼跃医疗	4,536,548.50	2.81
37	600702	舍得酒业	4,430,301.00	2.75
38	000756	新华制药	4,372,400.30	2.71
39	600332	白云山	4,323,773.00	2.68
40	600886	国投电力	4,322,636.00	2.68
41	600406	国电南瑞	4,296,600.00	2.66
42	601288	农业银行	4,289,500.00	2.66
43	600438	通威股份	4,197,407.00	2.60
44	600036	招商银行	4,125,933.00	2.56
45	600161	天坛生物	4,104,906.00	2.54
46	001979	招商蛇口	4,101,566.00	2.54
47	600048	保利地产	4,096,790.00	2.54
48	300003	乐普医疗	4,009,093.00	2.48
49	600267	海正药业	3,917,320.00	2.43

50	600056	中国医药	3,840,426.00	2.38
51	600749	西藏旅游	3,833,181.02	2.38
52	002020	京新药业	3,808,887.00	2.36
53	300347	泰格医药	3,787,513.34	2.35
54	600587	新华医疗	3,760,871.16	2.33
55	601988	中国银行	3,645,000.00	2.26
56	600718	东软集团	3,637,505.21	2.25
57	000705	浙江震元	3,601,697.85	2.23
58	002242	九阳股份	3,574,431.00	2.21
59	002758	华通医药	3,563,107.08	2.21
60	601607	上海医药	3,526,262.00	2.18
61	600277	亿利洁能	3,443,346.00	2.13
62	002159	三特索道	3,399,163.42	2.11
63	000069	华侨城 A	3,252,600.00	2.02
64	002262	恩华药业	3,248,304.60	2.01

8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	449,911,795.42
卖出股票收入（成交）总额	521,489,864.00

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,994,000.00	5.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	3,994,000.00	5.24

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019563	17国债09	40,000	3,994,000.00	5.24

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。

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

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 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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，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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

8.12.3 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	62,645.38
2	应收证券清算款	1,144,616.29
3	应收股利	-
4	应收利息	88,812.28
5	应收申购款	7,795.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,303,869.72

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
758	87,923.29	13,595,115.59	20.40%	53,050,735.27	79.60%

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	9.72	0.00%

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

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(2015年11月25日)基金份额总额	359,287,506.07
本报告期期初基金份额总额	164,329,107.39
本报告期基金总申购份额	42,223,106.52
减：本报告期基金总赎回份额	139,906,363.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	66,645,850.86

§ 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：

2017年1月16日，富安达基金管理有限公司发布《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日选举吴战峰先生担任董事会职工董事，免去金领千先生职工董事职务；

2017年3月23日，富安达基金管理有限公司发布《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日选举赵顺龙、刘健、江涛担任董事会独立董事，免去赵曙明、陈良华、马维勇独立董事职务；

2017年12月27日，富安达基金管理有限公司发布《富安达基金管理有限公司关于董事长变更的公告》，选举蒋晓刚先生担任公司董事长，并暂代总经理履职，解聘董事长、董事秦雁先生职务。

上述变动中的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，本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，本基金未召开基金份额持有人大会。

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60,000元人民币。

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，本基金管理人及其高级管理人员未受到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。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金公司	1	-	-	-	-	-

新时代证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	49,111,395.75	5.06%	45,737.28	5.54%	-
银河证券	1	248,549,670.88	25.61%	231,474.74	28.06%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	71,210,920.10	7.34%	66,318.58	8.04%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	73,428,325.99	7.57%	68,383.37	8.29%	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	228,162,204.80	23.51%	166,854.43	20.22%	-
国海证券	2	2,751,386.40	0.28%	2,012.02	0.24%	-
华龙证券	2	108,283,630.80	11.16%	79,188.42	9.60%	-
南京证券	2	32,723,930.10	3.37%	30,475.87	3.69%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	101,042,394.28	10.41%	94,100.73	11.41%	-
中投证券	2	55,336,489.74	5.70%	40,467.25	4.91%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-

华泰证券	3	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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、(38539)西南证券、(39181)方正证券、(004507)方正证券、(39632)中信建投、(394370)中信建投、(39241)华宝证券、(004602)华宝证券、(39931)东兴证券、(005319)东兴证券、(40427)浙商证券、(40387)新时代证券为本基金本期新增的交易单元。(28704)中国中投、(396770)中国中投为本期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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	6,59 6,22 3.35	68.34%	543,50 0,000. 00	40.16%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	270,00 0,000. 00	19.95%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	509,0 00.00	5.27%	305,00 0,000. 00	22.53%	-	-	-	-
国海证券	-	-	12,00 0,000. 00	0.89%	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-	-	-

南京证券	2,547,393.15	26.39%	33,000,000.00	2.44%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	190,000,000.00	14.04%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

富安达基金管理有限公司
二〇一八年三月三十一日