

富安达新兴成长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。

本报告期自 2017 年 1 月 1 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09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	195,184,713.08份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过股票与债券等资产的合理配置，通过深入研究并积极投资于新兴产业及其相关行业中的高速增长企业，分享新兴产业发展所带来的投资机会，在有效控制风险的前提下，力争为投资者带来长期的超额收益。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型，辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。一般情况下，本基金将大部分基金资产投资于新兴产业及其相关行业中成长型上市公司所发行的股票等证券，当证券市场系统性风险加大时，本基金将降低相关证券资产的配置比例。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和

	货币市场基金。
--	---------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沈伟青
	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年
本期已实现收益	-10,462,538.02	-13,728,184.37	59,240,935.35
本期利润	-9,433,347.67	-25,890,016.12	67,744,164.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0735	-0.3033	0.0618
本期基金份额净值增长率	21.60%	-20.38%	37.40%
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润	-0.0662	-0.0095	0.1987
期末基金资产净值	246,415,860.75	63,016,816.92	790,589,353.59
期末基金份额净值	1.2625	1.0382	1.3039

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	-11.87%	1.75%	-1.14%	0.64%	-10.73%	1.11%
过去六个月	9.42%	1.85%	3.00%	0.57%	6.42%	1.28%
过去一年	21.60%	1.61%	6.05%	0.52%	15.55%	1.09%
过去三年	33.03%	1.55%	20.73%	1.19%	12.30%	0.36%
自基金合同生效起至今	26.25%	1.57%	31.00%	1.16%	-4.75%	0.41%

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。

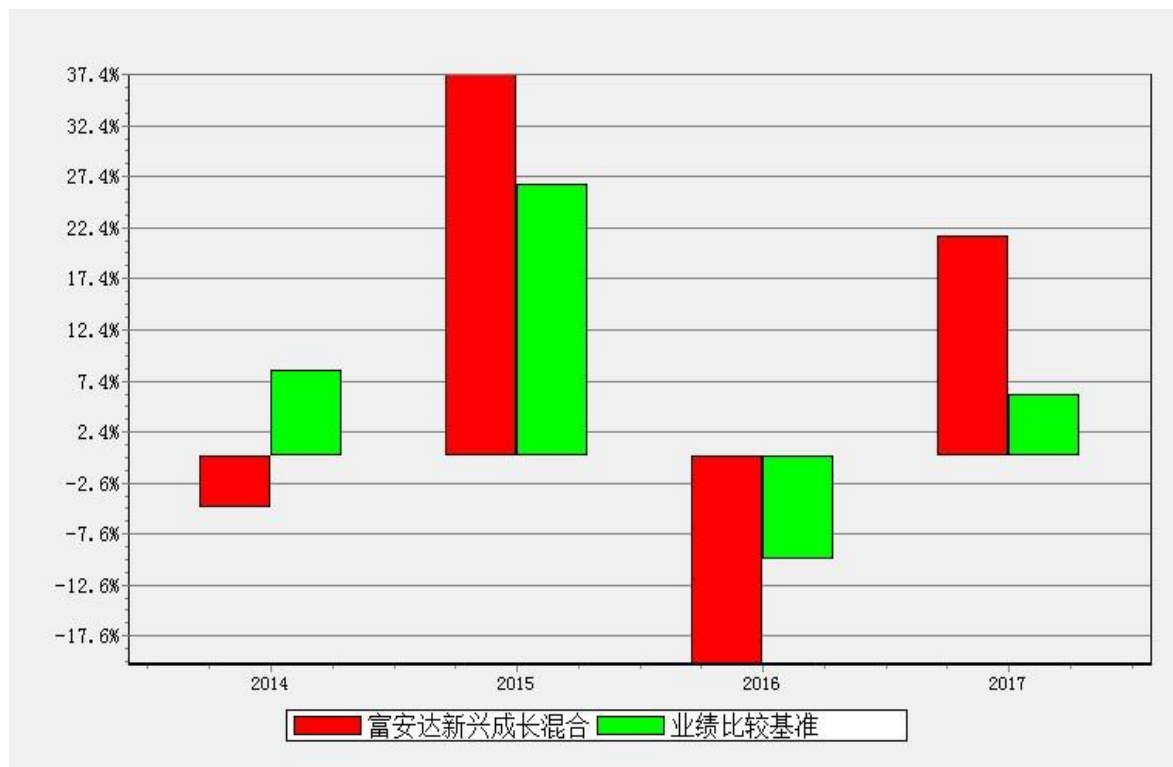
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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09月11日-2017年12月31日)



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



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2017年12月31日，公司共管理九只开放式基金：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、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		
孙绍冰	本基金的基金经理、公司研究发展部总监助理	2015-05-22	-	10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。

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，宏观经济虽有起伏，但总体平稳，表现出极强的韧性。流动性方面中性偏紧，供给侧改革深入推进，环保监管趋严，金融去杠杆持续，市场结构性特征明显，白马蓝筹个股表现抢眼，与此同时，相当一部分个股股价跌幅惨烈。

投资策略方面：本基金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和消费电子等相关行业的挖掘和研究，并取得了较好的投资回报；四季度，受行业政策面影响，相关板块及个股出现深幅调整，本基金虽相应对获利较高个股进行减仓处理，并紧跟市场风格，加大了对白马蓝筹配置，但应对仍存在不足之处，且本基金规模不够稳定，两项因素叠加导致本基金净值回撤仍高于同类基金。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金份额净值为1.2625元；本报告期内，基金份额净值增长率为21.60%，同期业绩比较基准收益率为6.05%。

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：一方面供给侧改革夯实了经济根基，随着海外经济体的持续复苏，预计国内经济2018年平稳可控；另一方面美国进入加息周期，这对国内货币政策造成牵制，此外国内金融去杠杆仍将继续推动，预计2018年流动性中性偏紧。2018年，我们认为政策层面将更为明确，追求有质量的增长，风险控制依然放在重要位置。2018年依然是结构性机会，新兴成长继续专注挖掘业绩增长与估值相匹配的投资机会。

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，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

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2018年3月29日签字出具了普华永道中天审字(2018)第21853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：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	16,209,226.89	1,938,373.02
结算备付金		3,052,494.36	13,257,488.77
存出保证金		317,103.54	92,852.69
交易性金融资产	7.4.7.2	228,477,607.59	50,182,204.80
其中：股票投资		228,477,607.59	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,935,179.71	2,414,455.89
应收利息	7.4.7.5	6,075.99	5,133.41
应收股利		-	-
应收申购款		889,129.41	52,318.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		254,886,817.49	67,942,827.32
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		3,165,780.70	3,065,471.97
应付赎回款		2,833,660.86	585,813.82
应付管理人报酬		328,448.45	86,357.09
应付托管费		54,741.42	14,392.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,714,210.80	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	7.4.7.8	374,114.51	461,009.15
负债合计		8,470,956.74	4,926,010.40
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	195,184,713.08	60,697,947.83
未分配利润	7.4.7.1 0	51,231,147.67	2,318,869.09
所有者权益合计		246,415,860.75	63,016,816.92
负债和所有者权益总计		254,886,817.49	67,942,827.32

报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.2625元，基金份额总额195,184,713.08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：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	上年度可比期间 2016年01月01日至201
-----	---------	------------------------------	----------------------------

		日	6年12月31日
一、收入		-938,436.68	-21,352,461.04
1. 利息收入		234,674.05	1,180,144.41
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	175,934.32	702,988.12
债券利息收入		58,739.73	-
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）		-5,979,906.70	-12,348,758.59
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	-6,221,843.90	-12,497,507.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	-6,760.00	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.1 3.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 5	-	-
股利收益	7.4.7.1 6	248,697.20	148,749.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 7	1,029,190.35	-12,161,831.75
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 8	3,777,605.62	1,977,984.89

减：二、费用		8,494,910.99	4,537,555.08
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	2,544,251.90	1,642,435.43
2. 托管费	7.4.10. 2.2	424,041.94	273,739.24
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.1 9	5,329,399.57	2,174,920.41
5. 利息支出		367.58	-
其中：卖出回购金融资产支出		367.58	-
6. 其他费用	7.4.7.2 0	196,850.00	446,460.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-9,433,347.67	-25,890,016.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-9,433,347.67	-25,890,016.12

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：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)	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)	-	-9,433,347.67	-9,433,347.67
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)	134,486,765.25	58,345,626.25	192,832,391.50

其中：1. 基金申购款	604,656,629.2 0	240,989,708.6 2	845,646,337.82
2. 基金赎回款	-470,169,863. 95	-182,644,082. 37	-652,813,946.32
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）	195,184,713.0 8	51,231,147.67	246,415,860.75
项 目	上年度可比期间 2016年01月01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）	606,321,031.5 4	184,268,322.0 5	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）	-	-25,890,016.1 2	-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	174,594,364.8 2	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

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

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。

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。

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 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01月01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	676,684,411.25	18.56%	-	-

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	630,194.80	19.25%	630,194.80	36.77%
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01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

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

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债券交易业务。

7.4.8.1.5 债券回购交易

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债券回购交易业务。

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01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,544,251.90	1,642,435.43

其中：支付销售机构的客户维护费	1,147,942.05	392,797.48
-----------------	--------------	------------

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1.5%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	上年度可比期间
	2017年01月01日至2017年12月31日	2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	424,041.94	273,739.24

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

本基金的基金管理人于本报告期内及上年度可比期间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		上年度末	
	2017年12月31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	7,73	3.96%	7,73	12.75%
	8,56		8,56	
	5.13		5.13	

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01月01日至2016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
	交通银行股份有限公 司	16,209,226. 89	62,277.34	1,938,373.0 2

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。

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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
0024 66	天齐 锂业	2017 -12- 26	2018 -01- 03	配股 上市 未流 通	11.0 6	53.2 1	25,890	286, 343. 40	1,37 7,60 6.90	-

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	复牌 日期	复牌 开盘	数量(股)	期末 成本	期末 估值	备注
----------	----------	----------	----------	----------	----------	----------	-------	----------	----------	----

				单价		单价		总额	总额	
601600	中国铝业	2017-09-12	重大资产重组	6.67	2018-02-26	7.28	3,570,000	26,763,321.56	23,811,900.00	-
601003	柳钢股份	2017-10-17	重大资产重组	7.98	2018-01-18	7.50	100,000	776,508.00	798,000.00	-
000688	建新矿业	2017-09-06	重大事项	10.95	2018-02-07	9.86	50,000	574,637.00	547,500.00	-
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	3,000	95,250.00	96,420.00	-
300156	神雾环保	2017-07-17	重大资产重组	24.16	2018-01-17	21.74	1,000	33,045.00	24,160.00	-
000820	神雾节能	2017-07-17	重大资产重组	28.96	2018-01-17	26.06	100	4,068.51	2,896.00	-

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201,819,124.69元，属于第二层次的余额为26,658,482.90元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次42,963,475.80元，第二层次7,218,729.00元，无属于第三层次的余额)。

(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截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(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	228,477,607.59	89.64
	其中：股票	228,477,607.59	89.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	19,261,721.25	7.56
8	其他各项资产	7,147,488.65	2.80
9	合计	254,886,817.49	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

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	973,930.00	0.40
C	制造业	220,429,470.59	89.45
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	712,500.00	0.29

G	交通运输、仓储和邮政业	1,601,600.00	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	937,744.00	0.38
J	金融业	679,510.00	0.28
K	房地产业	2,624,385.00	1.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	393,068.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	125,400.00	0.05
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	228,477,607.59	92.72

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	601600	中国铝业	3,570,000	23,811,900.00	9.66
2	600516	方大炭素	720,000	20,793,600.00	8.44
3	603799	华友钴业	150,500	12,074,615.00	4.90
4	600702	舍得酒业	230,400	10,750,464.00	4.36
5	600521	华海药业	344,000	10,361,280.00	4.20
6	000807	云铝股份	1,000,000	10,230,000.00	4.15
7	300316	晶盛机电	488,100	10,206,171.00	4.14

8	000338	潍柴动力	1,150,000	9,591,000.00	3.89
9	002384	东山精密	330,356	9,401,931.76	3.82
10	300136	信维通信	178,000	9,024,600.00	3.66

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	603799	华友钴业	65,727,063.00	104.30
2	002460	赣锋锂业	50,720,172.12	80.49
3	000002	万科A	50,053,555.56	79.43
4	600516	方大炭素	44,771,522.64	71.05
5	002635	安洁科技	40,744,560.50	64.66
6	002384	东山精密	38,064,143.60	60.40
7	002049	紫光国芯	37,925,933.00	60.18
8	002241	歌尔股份	36,705,155.42	58.25
9	300450	先导智能	36,136,645.00	57.34
10	600048	保利地产	35,408,647.00	56.19
11	300433	蓝思科技	35,374,170.32	56.13
12	002466	天齐锂业	34,822,653.89	55.26
13	600392	盛和资源	34,542,512.00	54.81
14	002456	欧菲科技	32,739,028.50	51.95
15	000063	中兴通讯	28,995,043.00	46.01
16	601600	中国铝业	27,456,497.00	43.57
17	000725	京东方A	26,894,300.00	42.68
18	600741	华域汽车	24,875,620.67	39.47
19	600111	北方稀土	24,662,670.00	39.14
20	600499	科达洁能	24,301,889.00	38.56
21	300038	梅泰诺	23,704,355.00	37.62

22	600104	上汽集团	23,490,924.00	37.28
23	002273	水晶光电	23,453,979.00	37.22
24	601398	工商银行	22,218,048.10	35.26
25	000961	中南建设	22,109,558.00	35.09
26	600779	水井坊	21,991,330.11	34.90
27	600584	长电科技	21,980,729.99	34.88
28	002497	雅化集团	21,923,912.83	34.79
29	300355	蒙草生态	21,238,329.00	33.70
30	600999	招商证券	21,205,251.00	33.65
31	002236	大华股份	20,970,513.00	33.28
32	601318	中国平安	20,796,788.58	33.00
33	600019	宝钢股份	17,362,924.00	27.55
34	300197	铁汉生态	15,685,018.25	24.89
35	000970	中科三环	15,658,511.14	24.85
36	002371	北方华创	15,608,738.00	24.77
37	300136	信维通信	14,965,374.00	23.75
38	600702	舍得酒业	14,868,122.65	23.59
39	300073	当升科技	14,744,115.72	23.40
40	600760	中航沈飞	14,242,676.85	22.60
41	000980	众泰汽车	14,228,455.00	22.58
42	300296	利亚德	14,137,117.00	22.43
43	002080	中材科技	13,677,325.64	21.70
44	600050	中国联通	12,488,000.00	19.82
45	600487	亨通光电	12,427,956.00	19.72
46	600031	三一重工	12,065,469.00	19.15
47	600585	海螺水泥	12,053,917.00	19.13
48	002583	海能达	11,840,770.00	18.79
49	600196	复星医药	11,642,645.13	18.48
50	300398	飞凯材料	11,527,708.00	18.29
51	000807	云铝股份	11,119,457.00	17.65
52	002038	双鹭药业	10,879,268.00	17.26

53	000671	阳光城	10,868,065.00	17.25
54	601933	永辉超市	10,818,037.00	17.17
55	600581	八一钢铁	10,769,446.41	17.09
56	601766	中国中车	10,489,118.00	16.64
57	002709	天赐材料	10,309,965.94	16.36
58	600183	生益科技	10,073,738.44	15.99
59	300316	鼎盛机电	10,021,762.00	15.90
60	300502	新易盛	9,920,318.00	15.74
61	300014	亿纬锂能	9,649,271.12	15.31
62	600507	方大特钢	9,519,257.00	15.11
63	000338	潍柴动力	9,506,000.00	15.08
64	600340	华夏幸福	9,488,629.00	15.06
65	600549	厦门钨业	9,362,914.00	14.86
66	600521	华海药业	9,208,485.00	14.61
67	000050	深天马 A	9,137,688.00	14.50
68	601012	隆基股份	9,047,175.00	14.36
69	002366	台海核电	8,959,837.00	14.22
70	600036	招商银行	8,757,958.90	13.90
71	002078	太阳纸业	8,666,410.00	13.75
72	002285	世联行	8,648,451.80	13.72
73	000789	万年青	8,607,723.00	13.66
74	600884	杉杉股份	8,276,072.00	13.13
75	002019	亿帆医药	8,028,092.00	12.74
76	600176	中国巨石	7,634,822.00	12.12
77	002281	光迅科技	7,548,684.00	11.98
78	600438	通威股份	7,538,744.00	11.96
79	000333	美的集团	7,434,000.00	11.80
80	300146	汤臣倍健	7,328,878.85	11.63
81	300373	扬杰科技	7,096,093.00	11.26
82	603019	中科曙光	6,935,670.00	11.01
83	300340	科恒股份	6,749,880.60	10.71

84	002407	多氟多	6,679,722.00	10.60
85	002405	四维图新	6,479,147.52	10.28
86	600068	葛洲坝	6,345,200.00	10.07
87	300115	长盈精密	5,885,815.00	9.34
88	600161	天坛生物	5,688,126.00	9.03
89	600271	航天信息	5,439,204.00	8.63
90	600967	内蒙一机	5,187,240.00	8.23
91	600038	中直股份	5,154,205.32	8.18
92	300347	泰格医药	5,103,645.00	8.10
93	601668	中国建筑	5,046,379.00	8.01
94	600072	中船科技	5,034,521.00	7.99
95	600362	江西铜业	4,951,401.17	7.86
96	000001	平安银行	4,836,000.00	7.67
97	002008	大族激光	4,740,858.00	7.52
98	002127	南极电商	4,722,865.00	7.49
99	300394	天孚通信	4,604,000.00	7.31
100	300349	金卡智能	4,567,521.00	7.25
101	000651	格力电器	4,497,000.00	7.14
102	300274	阳光电源	4,412,841.32	7.00
103	000049	德赛电池	4,252,484.00	6.75
104	600456	宝钛股份	4,215,757.00	6.69
105	000065	北方国际	4,214,364.00	6.69
106	000831	五矿稀土	4,138,200.00	6.57
107	000801	四川九洲	3,992,500.00	6.34
108	601800	中国交建	3,971,938.00	6.30
109	000951	中国重汽	3,964,117.00	6.29
110	300224	正海磁材	3,963,800.00	6.29
111	601688	华泰证券	3,885,680.00	6.17
112	000921	海信科龙	3,873,374.00	6.15
113	002230	科大讯飞	3,857,026.00	6.12
114	000581	威孚高科	3,824,564.00	6.07

115	300100	双林股份	3,748,160.00	5.95
116	600690	青岛海尔	3,743,500.00	5.94
117	600970	中材国际	3,610,900.00	5.73
118	002051	中工国际	3,518,500.00	5.58
119	000768	中航飞机	3,507,330.00	5.57
120	601601	中国太保	3,493,998.00	5.54
121	000418	小天鹅 A	3,362,129.20	5.34
122	600316	洪都航空	3,335,700.00	5.29
123	000878	云南铜业	3,271,132.45	5.19
124	002156	通富微电	3,120,400.00	4.95
125	601633	长城汽车	3,078,288.00	4.88
126	601101	昊华能源	3,031,000.00	4.81
127	603993	洛阳钼业	2,974,500.00	4.72
128	300335	迪森股份	2,957,426.00	4.69
129	002048	宁波华翔	2,952,700.00	4.69
130	000820	神雾节能	2,951,096.00	4.68
131	002043	兔宝宝	2,912,200.00	4.62
132	600547	山东黄金	2,890,780.00	4.59
133	600816	安信信托	2,861,500.00	4.54
134	000786	北新建材	2,834,900.00	4.50
135	600000	浦发银行	2,763,800.00	4.39
136	300070	碧水源	2,747,380.00	4.36
137	002074	国轩高科	2,736,212.95	4.34
138	600426	华鲁恒升	2,683,900.00	4.26
139	600699	均胜电子	2,677,481.00	4.25
140	002636	金安国纪	2,655,913.00	4.21
141	002475	立讯精密	2,611,508.80	4.14
142	600809	山西汾酒	2,567,218.00	4.07
143	601699	潞安环能	2,557,500.00	4.06
144	300219	鸿利智汇	2,537,700.00	4.03
145	600685	中船防务	2,516,480.00	3.99

146	600015	华夏银行	2,493,500.00	3.96
147	000688	建新矿业	2,462,337.00	3.91
148	002307	北新路桥	2,422,000.00	3.84
149	601117	中国化学	2,421,000.00	3.84
150	601666	平煤股份	2,381,000.00	3.78
151	600477	杭萧钢构	2,341,810.00	3.72
152	600343	航天动力	2,330,242.00	3.70
153	600066	宇通客车	2,277,353.50	3.61
154	002271	东方雨虹	2,260,000.00	3.59
155	600546	山煤国际	2,225,100.00	3.53
156	600782	新钢股份	2,215,000.00	3.51
157	002427	ST尤夫	2,162,835.00	3.43
158	300408	三环集团	2,157,025.13	3.42
159	000498	山东路桥	2,143,986.00	3.40
160	000823	超声电子	2,087,100.00	3.31
161	002110	三钢闽光	2,067,069.00	3.28
162	002007	华兰生物	2,006,600.00	3.18
163	002624	完美世界	1,967,500.00	3.12
164	600110	诺德股份	1,957,977.00	3.11
165	600436	片仔癀	1,952,051.00	3.10
166	002340	格林美	1,934,000.00	3.07
167	000915	山大华特	1,898,000.00	3.01
168	002192	融捷股份	1,894,840.00	3.01
169	002283	天润曲轴	1,881,197.60	2.99
170	600885	宏发股份	1,875,920.00	2.98
171	600677	航天通信	1,859,855.00	2.95
172	000983	西山煤电	1,782,601.00	2.83
173	600166	福田汽车	1,761,500.00	2.80
174	601636	旗滨集团	1,723,000.00	2.73
175	300497	富祥股份	1,691,652.76	2.68
176	300122	智飞生物	1,684,344.00	2.67

177	601166	兴业银行	1,639,881.00	2.60
178	002179	中航光电	1,639,508.00	2.60
179	601965	中国汽研	1,631,377.00	2.59
180	600871	石化油服	1,592,000.00	2.53
181	300116	坚瑞沃能	1,580,600.00	2.51
182	002600	领益智造	1,558,500.00	2.47
183	601100	恒立液压	1,530,500.00	2.43
184	601003	柳钢股份	1,525,508.00	2.42
185	002555	三七互娱	1,502,200.00	2.38
186	002543	万和电气	1,495,764.00	2.37
187	601111	中国国航	1,448,000.00	2.30
188	002716	金贵银业	1,427,000.00	2.26
189	002050	三花智控	1,426,772.00	2.26
190	002355	兴民智通	1,391,900.00	2.21
191	600338	西藏珠峰	1,347,100.00	2.14
192	002148	北纬科技	1,326,500.00	2.10
193	300034	钢研高纳	1,326,000.00	2.10

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	603799	华友钴业	55,506,750.00	88.08
2	000002	万科A	49,273,894.45	78.19
3	002460	赣锋锂业	49,140,046.20	77.98
4	002049	紫光国芯	44,003,524.00	69.83
5	002635	安洁科技	38,766,567.77	61.52
6	002456	欧菲科技	36,366,584.00	57.71
7	002241	歌尔股份	36,154,735.21	57.37
8	300450	先导智能	35,116,210.06	55.73

9	600392	盛和资源	33,468,713.77	53.11
10	300433	蓝思科技	32,759,596.35	51.99
11	600048	保利地产	32,295,528.00	51.25
12	002384	东山精密	31,010,849.00	49.21
13	002466	天齐锂业	30,275,197.08	48.04
14	000725	京东方 A	27,487,300.00	43.62
15	600516	方大炭素	27,385,329.34	43.46
16	600111	北方稀土	24,724,873.00	39.24
17	600741	华域汽车	24,234,488.86	38.46
18	600104	上汽集团	24,160,464.00	38.34
19	600499	科达洁能	23,871,411.76	37.88
20	002273	水晶光电	23,167,073.71	36.76
21	601398	工商银行	22,931,978.00	36.39
22	300038	梅泰诺	22,902,157.00	36.34
23	000063	中兴通讯	22,307,215.00	35.40
24	600999	招商证券	21,746,762.00	34.51
25	002236	大华股份	21,695,345.81	34.43
26	300355	蒙草生态	21,044,133.70	33.39
27	600584	长电科技	21,013,126.00	33.35
28	000961	中南建设	20,819,950.00	33.04
29	601318	中国平安	20,430,037.00	32.42
30	002497	雅化集团	20,405,532.77	32.38
31	600019	宝钢股份	17,070,577.24	27.09
32	300197	铁汉生态	14,823,325.10	23.52
33	002371	北方华创	14,736,404.00	23.38
34	300296	利亚德	14,586,610.46	23.15
35	000970	中科三环	14,476,256.00	22.97
36	300073	当升科技	14,457,558.00	22.94
37	600779	水井坊	13,870,998.00	22.01
38	000980	众泰汽车	13,819,761.00	21.93
39	002080	中材科技	13,134,300.94	20.84

40	600487	亨通光电	12,589,552.00	19.98
41	600050	中国联通	12,370,000.00	19.63
42	600585	海螺水泥	12,173,019.30	19.32
43	000671	阳光城	11,389,224.00	18.07
44	002583	海能达	11,338,933.00	17.99
45	601933	永辉超市	10,857,692.53	17.23
46	300398	飞凯材料	10,842,747.00	17.21
47	002709	天赐材料	9,872,820.00	15.67
48	600760	中航沈飞	9,853,413.00	15.64
49	000789	万年青	9,729,345.17	15.44
50	600183	生益科技	9,724,447.60	15.43
51	300014	亿纬锂能	9,665,321.20	15.34
52	600581	八一钢铁	9,656,739.00	15.32
53	600340	华夏幸福	9,439,038.60	14.98
54	601012	隆基股份	9,320,916.00	14.79
55	002038	双鹭药业	9,275,695.36	14.72
56	600507	方大特钢	9,212,566.00	14.62
57	600549	厦门钨业	9,130,212.90	14.49
58	300502	新易盛	8,811,229.00	13.98
59	600036	招商银行	8,423,602.00	13.37
60	002078	太阳纸业	8,363,887.00	13.27
61	000050	深天马 A	8,101,893.00	12.86
62	600884	杉杉股份	7,941,059.96	12.60
63	002285	世联行	7,906,215.16	12.55
64	002366	台海核电	7,795,955.00	12.37
65	002019	亿帆医药	7,715,197.00	12.24
66	000333	美的集团	7,642,614.00	12.13
67	300146	汤臣倍健	7,131,834.00	11.32
68	002407	多氟多	6,768,310.00	10.74
69	600038	中直股份	6,690,602.75	10.62
70	600031	三一重工	6,648,500.00	10.55

71	002048	宁波华翔	6,538,585.50	10.38
72	600967	内蒙一机	6,384,400.00	10.13
73	600068	葛洲坝	6,214,000.00	9.86
74	002405	四维图新	5,962,046.55	9.46
75	300340	科恒股份	5,750,730.00	9.13
76	600161	天坛生物	5,730,130.00	9.09
77	300115	长盈精密	5,652,256.00	8.97
78	300373	扬杰科技	5,621,077.00	8.92
79	603019	中科曙光	5,528,343.00	8.77
80	300136	信维通信	5,518,679.00	8.76
81	600072	中船科技	5,266,600.20	8.36
82	601766	中国中车	5,168,500.00	8.20
83	600271	航天信息	5,138,525.00	8.15
84	600685	中船防务	5,075,780.00	8.05
85	601668	中国建筑	4,988,000.00	7.92
86	600196	复星医药	4,826,497.00	7.66
87	002008	大族激光	4,825,975.00	7.66
88	300347	泰格医药	4,750,389.00	7.54
89	002127	南极电商	4,699,948.00	7.46
90	000768	中航飞机	4,639,512.00	7.36
91	000831	五矿稀土	4,561,584.00	7.24
92	600438	通威股份	4,511,394.00	7.16
93	300100	双林股份	4,418,256.56	7.01
94	000001	平安银行	4,353,650.00	6.91
95	000049	德赛电池	4,331,661.17	6.87
96	000065	北方国际	4,301,822.00	6.83
97	000651	格力电器	4,262,377.00	6.76
98	300394	天孚通信	4,178,559.00	6.63
99	600456	宝钛股份	4,145,156.00	6.58
100	600362	江西铜业	3,984,970.39	6.32
101	601800	中国交建	3,969,551.00	6.30

102	000801	四川九洲	3,926,943.00	6.23
103	600702	舍得酒业	3,907,200.00	6.20
104	000921	海信科龙	3,868,292.00	6.14
105	601688	华泰证券	3,842,747.00	6.10
106	600690	青岛海尔	3,762,769.84	5.97
107	300224	正海磁材	3,605,000.00	5.72
108	000418	小天鹅 A	3,554,735.00	5.64
109	600970	中材国际	3,545,396.00	5.63
110	002353	杰瑞股份	3,492,213.00	5.54
111	002051	中工国际	3,464,376.11	5.50
112	000655	金岭矿业	3,451,241.05	5.48
113	601601	中国太保	3,316,773.00	5.26
114	600316	洪都航空	3,300,910.67	5.24
115	002230	科大讯飞	3,200,000.00	5.08
116	601633	长城汽车	3,084,560.00	4.89
117	002013	中航机电	3,047,817.00	4.84
118	603993	洛阳钼业	3,020,000.00	4.79
119	002156	通富微电	3,015,701.02	4.79
120	300164	通源石油	3,004,545.62	4.77
121	600176	中国巨石	2,999,303.00	4.76
122	000878	云南铜业	2,997,946.40	4.76
123	300237	美晨生态	2,915,536.00	4.63
124	002064	华峰氨纶	2,856,510.00	4.53
125	000820	神雾节能	2,854,829.00	4.53
126	600547	山东黄金	2,850,510.00	4.52
127	002307	北新路桥	2,831,520.00	4.49
128	002636	金安国纪	2,817,020.00	4.47
129	300335	迪森股份	2,808,579.00	4.46
130	601101	昊华能源	2,772,476.00	4.40
131	300070	碧水源	2,770,084.00	4.40
132	600816	安信信托	2,742,000.00	4.35

133	000951	中国重汽	2,725,823.00	4.33
134	002648	卫星石化	2,712,347.86	4.30
135	600426	华鲁恒升	2,708,600.00	4.30
136	600000	浦发银行	2,708,000.00	4.30
137	002074	国轩高科	2,670,377.21	4.24
138	002475	立讯精密	2,616,572.40	4.15
139	600015	华夏银行	2,562,500.00	4.07
140	002043	兔宝宝	2,556,000.00	4.06
141	601699	潞安环能	2,546,334.00	4.04
142	002271	东方雨虹	2,414,534.00	3.83
143	600477	杭萧钢构	2,411,688.96	3.83
144	601117	中国化学	2,411,166.00	3.83
145	600699	均胜电子	2,403,674.00	3.81
146	300219	鸿利智汇	2,379,348.00	3.78
147	600759	洲际油气	2,365,408.00	3.75
148	000786	北新建材	2,359,563.00	3.74
149	600343	航天动力	2,307,314.00	3.66
150	601666	平煤股份	2,247,000.00	3.57
151	600066	宇通客车	2,220,800.00	3.52
152	000498	山东路桥	2,179,900.00	3.46
153	600782	新钢股份	2,176,000.00	3.45
154	600546	山煤国际	2,130,800.00	3.38
155	002427	ST尤夫	2,102,699.00	3.34
156	600436	片仔癀	2,043,657.00	3.24
157	300408	三环集团	2,041,500.00	3.24
158	000901	航天科技	2,038,251.00	3.23
159	600809	山西汾酒	2,019,420.88	3.20
160	600110	诺德股份	2,010,354.00	3.19
161	002554	惠博普	2,005,288.00	3.18
162	002007	华兰生物	1,993,663.00	3.16
163	300084	海默科技	1,981,483.38	3.14

164	002624	完美世界	1,962,906.00	3.11
165	000823	超声电子	1,959,069.00	3.11
166	002110	三钢闽光	1,940,000.00	3.08
167	600150	中国船舶	1,931,937.00	3.07
168	000915	山大华特	1,895,128.00	3.01
169	002340	格林美	1,864,500.00	2.96
170	600885	宏发股份	1,859,285.00	2.95
171	000688	建新矿业	1,836,200.00	2.91
172	000983	西山煤电	1,834,990.00	2.91
173	002283	天润曲轴	1,816,469.55	2.88
174	600960	渤海活塞	1,792,718.54	2.84
175	600677	航天通信	1,789,200.00	2.84
176	002192	融捷股份	1,787,272.00	2.84
177	600166	福田汽车	1,776,000.00	2.82
178	300122	智飞生物	1,761,821.84	2.80
179	601636	旗滨集团	1,746,000.00	2.77
180	300497	富祥股份	1,744,735.00	2.77
181	300210	森远股份	1,703,552.00	2.70
182	601166	兴业银行	1,681,000.00	2.67
183	002179	中航光电	1,670,630.00	2.65
184	601965	中国汽研	1,643,279.63	2.61
185	600871	石化油服	1,570,000.00	2.49
186	002555	三七互娱	1,469,285.00	2.33
187	300116	坚瑞沃能	1,468,704.00	2.33
188	002600	领益智造	1,465,711.00	2.33
189	002281	光迅科技	1,460,000.00	2.32
190	002543	万和电气	1,449,023.00	2.30
191	002509	天广中茂	1,442,054.00	2.29
192	002050	三花智控	1,398,195.00	2.22
193	002716	金贵银业	1,397,200.00	2.22
194	002148	北纬科技	1,334,424.00	2.12

195	002355	兴民智通	1,319,500.00	2.09
196	300034	钢研高纳	1,279,500.00	2.03
197	600889	南京化纤	1,271,033.00	2.02

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,914,830,325.49
卖出股票收入（成交）总额	1,731,342,269.15

“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

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

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

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	317,103.54
2	应收证券清算款	5,935,179.71
3	应收股利	-
4	应收利息	6,075.99
5	应收申购款	889,129.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,147,488.65

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	601600	中国铝业	23,811,900.00	9.66	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
16,354	11,934.98	7,740,407.60	3.97%	187,444,305.48	96.03%

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	5,240.44	0.003%

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(2014年09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	604,656,629.20
减：本报告期基金总赎回份额	470,169,863.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	195,184,713.08

§ 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	89,908,167.99	2.47%	83,731.47	2.56%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	405,431,940.12	11.12%	377,578.78	11.53%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	92,364,609.96	2.53%	86,019.34	2.63%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	203,738,564.28	5.59%	189,741.34	5.79%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	151,918,785.59	4.17%	141,481.10	4.32%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	88,080,148.84	2.42%	64,412.91	1.97%	-
兴业证券	2	145,298,611.90	3.99%	135,317.06	4.13%	-
招商证券	2	425,855,620.08	11.68%	396,599.63	12.11%	-
中泰证券	2	646,459,659.17	17.73%	602,048.55	18.39%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	2	234,467,029.87	6.43%	171,465.29	5.24%	-
中信证券	2	57,630,196.50	1.58%	53,670.87	1.64%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	2	676,684,411.25	18.56%	630,194.80	19.25%	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	41,389,500.80	1.14%	30,268.01	0.92%	-

东兴证券	2	94,637,904.88	2.60%	88,136.70	2.69%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	241,648,521.56	6.63%	176,717.45	5.40%	-
广发证券	2	50,372,578.45	1.38%	46,912.00	1.43%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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、(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
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 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。

12.2 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
二〇一八年三月三十一日