

# 富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

## 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:南京银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8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未经审计。

本报告期自2018年04月04日起至2018年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
7.7 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	44
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46

§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	富安达行业轮动混合
基金主代码	001660
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年04月04日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	南京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	265,150,689.48份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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。
业绩比较基准	$60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中国债券总指数收益率}$
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

### 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	南京银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	沈伟青	王峰
	联系电话	021-61870999	021-24198808
	电子邮箱	service@fadfunds.com	wangf@nicbtg.com
客户服务电话	400-630-6999（免长途）021-61870666	95302	
传真	021-61870888	021-54662130	
注册地址	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	南京市中山路288号	
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	上海市徐家汇路518号南京银行	
邮政编码	200122	200025	
法定代表人	蒋晓刚	胡升荣	

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《证券日报》
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

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

### § 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（2018年04月04日（基金合同生效日）- 2018年06月30日）
本期已实现收益	-3,490,870.78
本期利润	-13,110,844.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0379
本期加权平均净值利润率	-3.80%
本期基金份额净值增长率	-4.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年06月30日）
期末可供分配利润	-13,001,099.57
期末可供分配基金份额利润	-0.0490
期末基金资产净值	252,149,589.91
期末基金份额净值	0.951
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-4.90%

### 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	-4.71%	0.83%	-4.24%	0.76%	-0.47%	0.07%
自基金合同生效起至今	-4.90%	0.52%	-4.50%	0.69%	-0.40%	-0.17%

①本基金业绩比较基准为：60%×沪深300指数+40%×中债总指数，

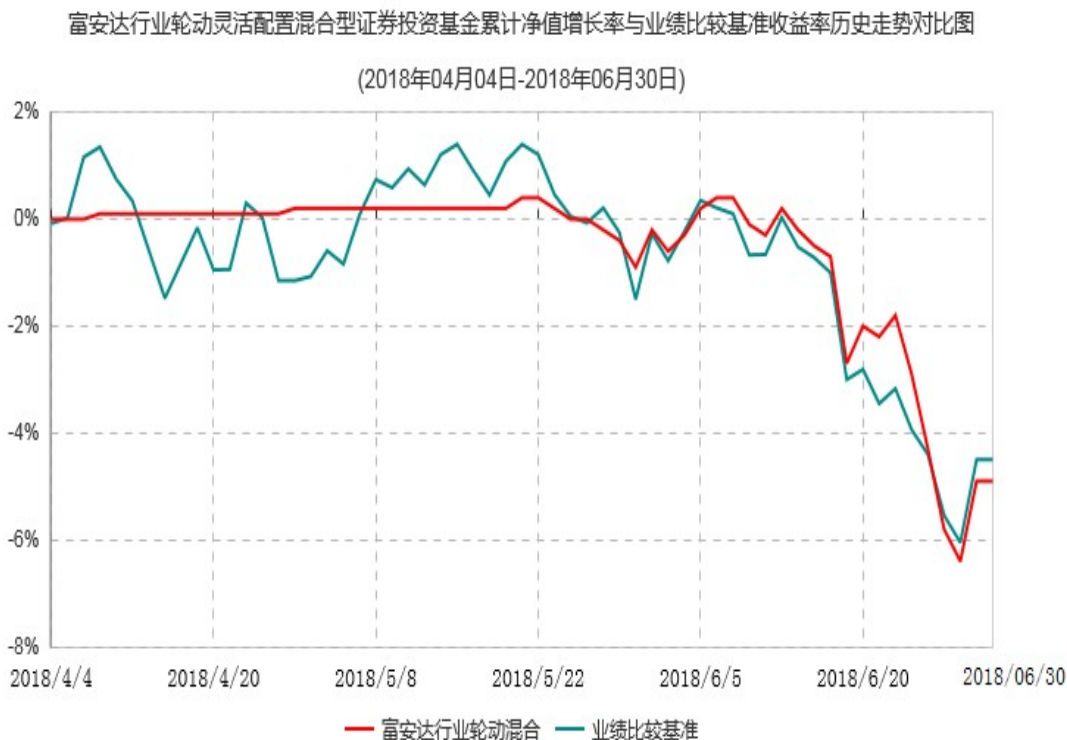
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

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

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

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



本基金于2018年4月4日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。本基金建仓期为自本基金合同生效之日起六个月，截止至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

## § 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8.18亿元人民币。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2018年6月30日，公司共管理10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、富安达长盈灵活配置混合型证



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、富安达行业轮动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		
毛矛	本基金的基金经理	2018-04-04	-	14年	硕士。历任中华资源（香港）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、富安达消费主题灵活配置混合型基金、富安达行业轮动灵活配置混合型基金的基金经理。

#### 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、《富安达行业轮动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，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

18年上半年市场下跌幅度较大，上证指数下跌13.9%、创业板指数下跌8.33%，行业轮动在二季度下跌4.9%，跑赢了指数、基本跑平基准。二季度我们建立了一定的权益类仓位，随着市场调整我们会继续提高仓位，我们认为从中长期来看，市场已经进入了价值区域，隐含了较高的中长期回报率；我们认为贸易战以及去杠杆政策导致市场对经济预期转向悲观是下跌的主要原因，我们判断经济整体状况优于前几轮经济下滑时的状态，出现极度悲观情况的概率较小。行业配置上以金融、地产及部分消费类行业为主，金融地产距离历史最低估值水平已经非常接近，下跌空间有限。固定收益方面，近期低等级公司债、企业债收益率上升较快，我们会逐步选择一些收益风险比较高的进行配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金份额净值为0.951元，本报告期内，基金份额净值增长率为-4.90%，同期业绩比较基准收益率为-4.50%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济走势平稳，GDP、工业增加值等经济指标都比较稳定，但先行指标回落较快，如社融、M2等，反映了融资收紧、去杠杆的政策趋势；我们预计下半年经济增速会有所下降，但整体风险可控，过去2-3年的去产能以及环保政策，导致大部分的中上游行业的产能过剩情况大幅度缓解，而且预计未来新上产能也非常有限，因此我们认为即使总需求有所回落，也很难出现如11-15年的长期的产能过剩导致的通缩及坏账风险。证券市场方面，年初至今市场的下跌，反映了去杠杆、贸易战导致的对经济未来悲观的预期，风险溢价高企导致估值出现较大的分化，大部分基本面和经济相关性不大的行业

表现较好，估值处在较高水平，而周期性的行业表现较差，估值处于历史低位，我们认为短期经济回落的风险被市场高估，未来有修复的机会。

#### 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。

### § 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

2018年度上半年，基金托管人在富安达行业轮动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

2018年度上半年，富安达基金管理有限公司在富安达行业轮动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

2018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行业轮动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：富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年06月30日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	39,552,314.78
结算备付金		8,330,429.79
存出保证金		68,541.07
交易性金融资产	6.4.7.2	134,148,384.71
其中：股票投资		126,975,748.01
基金投资		-
债券投资		7,172,636.70
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		72,745,550.35
应收利息	6.4.7.5	140,514.07
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		254,985,734.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>

		2018年06月30日
<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		-
应付赎回款		2,314,686.63
应付管理人报酬		203,269.49
应付托管费		56,463.74
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	219,826.09
应交税费		168.09
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	41,730.82
负债合计		2,836,144.86
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	265,150,689.48
未分配利润	6.4.7.10	-13,001,099.57
所有者权益合计		252,149,589.91
负债和所有者权益总计		254,985,734.77

报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.951元，基金份额总额265,150,689.48份。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06
-----	-----	--------------------------------

		月30日
<b>一、收入</b>		-11,808,962.06
1. 利息收入		2,035,612.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,550,743.40
债券利息收入		12,863.36
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		472,005.66
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,752,187.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,969,774.69
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	1,217,587.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,619,974.07
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	527,586.74
<b>减：二、费用</b>		1,301,882.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	747,816.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	207,726.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	307,098.33
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		18.01
7. 其他费用	6.4.7.20	39,222.96

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,110,844.85
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,110,844.85

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06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)	405,878,750.21	-	405,878,750.21
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	-13,110,844.85	-13,110,844.85
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)	-140,728,060.73	109,745.28	-140,618,315.45
其中：1. 基金申购款	71,486.51	-958.48	70,528.03
2. 基金赎回 款	-140,799,547.24	110,703.76	-140,688,843.48
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)	265,150,689.48	-13,001,099.57	252,149,589.91

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

富安达行业轮动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”)《关于准予富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1443号文)、中国证监会证券基金机构监管部《关于富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函[2017]710号)、中国证监会证券基金机构监管部《关于同意富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的函》(机构部函[2017]2502号)的批准,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》等相关法律法规及《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》发售,基金合同于2018年4月4日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为405,878,750.21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,基金托管人为南京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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、资产支持证券、货币市场工具、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,在履行适当程序后,本基金可以将其纳入投资范围。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%;投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-100%,其中权证投资比例不得超过基金资产净值的3%,任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

### 6.4.2 会计报表的编制基础



本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况、自2018年4月4日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2018年4月4日(基金合同生效日)至2018年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金目前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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应

将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益和债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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

本基金在自2018年4月4日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在自2018年4月4日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在自2018年4月4日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 主要税项说明

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 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。

(f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率,计算缴纳城市维护建设税。

(h)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	39,552,314.78
定期存款	-
其中:存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	39,552,314.78

定期存款期限指于资产负债表日定期存单剩余到期期限。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末2018年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	136,595,475.86	126,975,748.01	-9,619,727.85	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,291,502.92	2,290,136.70	-1,366.22
	银行间市场	4,881,380.00	4,882,500.00	1,120.00
	合计	7,172,882.92	7,172,636.70	-246.22
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	143,768,358.78	134,148,384.71	-9,619,974.07

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应收活期存款利息	7,234.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,373.83
应收债券利息	150,016.78
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-20,139.18
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	27.81
合计	140,514.07

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。



## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	219,542.51
银行间市场应付交易费用	283.58
合计	219,826.09

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,907.86
预提费用	38,822.96
合计	41,730.82

申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	405,878,750.21	405,878,750.21
本期申购	71,486.51	71,486.51
本期赎回（以“-”号填列）	-140,799,547.24	-140,799,547.24
本期末	265,150,689.48	265,150,689.48

1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。
2. 本基金截至2018年4月3日，基金托管专户已收到首次发售募集扣除认购费后的有效认购资金人民币405,650,600.62元，孳生利息人民币228,149.59元，共计人民币405,878,750.21元，折合405,878,750.21份基金份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,490,870.78	-9,619,974.07	-13,110,844.85
本期基金份额交易产生的变动数	-187,622.18	297,367.46	109,745.28
其中：基金申购款	-91.22	-867.26	-958.48
基金赎回款	-187,530.96	298,234.72	110,703.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,678,492.96	-9,322,606.61	-13,001,099.57

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
活期存款利息收入	157,916.55
定期存款利息收入	1,383,000.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,746.61
其他	80.24
合计	1,550,743.40

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
卖出股票成交总额	63,453,846.80
减：卖出股票成本总额	69,423,621.49
买卖股票差价收入	-5,969,774.69

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内未获得债券投资收益。

**6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内未获得资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内未获得贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内未获得衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,217,587.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,217,587.54

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-9,619,974.07
——股票投资	-9,619,727.85
——债券投资	-246.22
——资产支持证券投资	-

——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,619,974.07

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
基金赎回费收入	527,586.74
合计	527,586.74

1. 本基金的赎回费率，赎回费不低于其总额的25%归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
交易所市场交易费用	306,935.83
银行间市场交易费用	162.50
合计	307,098.33

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
审计费用	19,411.92
信息披露费	19,411.04
其他	400.00
合计	39,222.96

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

##### 6.4.9.2 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
南京银行股份有限公司（“南京银行”）	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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
南京证券	112,384,427.51	41.71%

## 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06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	962,100,000.00	33.12%

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30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	104,663.68	47.67%	104,663.68	47.67%
南京证券	-	-	-	-

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	747,816.68
其中：支付销售机构的客户维护费	113,395.87

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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	207,726.81

- 支付基金托管人南京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。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

##### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 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 2018年06月30日	
	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	9,999,000.00	3.77%
南京证券股份有限公司	9,999,000.00	3.77%

**6.4.10.5 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 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
南京银行	39,552,314.78	157,916.55

本基金的银行存款由基金托管人南京银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况--非货币市场基金**

本基金本报告期无利润分配。

**6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券**



#### 6.4.12.1 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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型证券投资基金，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。本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、总经理、董事会及中国证监会。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行南京银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2018年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2018年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构

成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末2	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
------	------	------	------	-----	----

018年06月30日					
资产					
银行存款	39,552,314.78	-	-	-	39,552,314.78
结算备付金	8,330,429.79	-	-	-	8,330,429.79
存出保证金	68,541.07	-	-	-	68,541.07
交易性金融资产	4,882,500.00	2,290,136.70	-	126,975,748.01	134,148,384.71
应收证券清算款	-	-	-	72,745,550.35	72,745,550.35
应收利息	-	-	-	140,514.07	140,514.07
资产总计	52,833,785.64	2,290,136.70	-	199,861,812.43	254,985,734.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,314,686.63	2,314,686.63
应付管理人报酬	-	-	-	203,269.49	203,269.49
应付托管费	-	-	-	56,463.74	56,463.74
应付交易费用	-	-	-	219,826.09	219,826.09
应交税费	-	-	-	168.09	168.09
其他负债	-	-	-	41,730.82	41,730.82
负债总计	-	-	-	2,836,144.86	2,836,144.86
利率敏感度缺口	52,833,785.64	2,290,136.70	-	197,025,667.57	252,149,589.91

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金生效日期为2018年4月4日。截至报告期末，本基金尚处于建仓期，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为2.84%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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，结合联储模型，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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资比例范围为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%；投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的3%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	126,975,748.01	50.36
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	126,975,748.01	50.36

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金生效日期为2018年4月4日。截至报告期末，本基金尚处于建仓期，成立未满一年，无足够的经验数据进行市场价格风险分析。

#### 6.4.14 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，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确定做出规定。

上述税收政策对本基金2018年6月30日的财务状况和2018年度上半年的经营成果无影响。

(2) 除增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	126,975,748.01	49.80
	其中：股票	126,975,748.01	49.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,172,636.70	2.81
	其中：债券	7,172,636.70	2.81
	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	47,882,744.57	18.78
8	其他各项资产	72,954,605.49	28.61
9	合计	254,985,734.77	100.00

由于四舍五入的原因，各比例的分项与合计可能有尾差。

## 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

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	55,915,339.55	22.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,041,555.54	2.40
F	批发和零售业	7,958,609.56	3.16

G	交通运输、仓储和邮政业	7,252,862.93	2.88
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	15,378,644.02	6.10
K	房地产业	32,240,160.51	12.79
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,856,890.00	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	331,685.90	0.13
S	综合	-	-
	合计	126,975,748.01	50.36

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600048	保利地产	1,081,400	13,193,080.00	5.23
2	600466	蓝光发展	1,248,250	7,739,150.00	3.07
3	601288	农业银行	2,249,100	7,736,904.00	3.07
4	002327	富安娜	628,900	6,817,276.00	2.70
5	000651	格力电器	125,100	5,898,465.00	2.34
6	002293	罗莱生活	374,200	5,624,226.00	2.23
7	002146	荣盛发展	563,700	4,921,101.00	1.95
8	603008	喜临门	244,200	4,830,276.00	1.92
9	601668	中国建筑	805,280	4,396,828.80	1.74
10	601877	正泰电器	181,300	4,046,616.00	1.60
11	001979	招商蛇口	187,371	3,569,417.55	1.42



12	002120	韵达股份	65,436	3,471,379.80	1.38
13	601601	中国太保	99,100	3,156,335.00	1.25
14	600176	中国巨石	304,117	3,111,116.91	1.23
15	002867	周大生	94,400	2,972,656.00	1.18
16	603886	元祖股份	147,600	2,925,432.00	1.16
17	002029	七匹狼	352,739	2,818,384.61	1.12
18	002024	苏宁易购	195,282	2,749,570.56	1.09
19	600884	杉杉股份	123,700	2,733,770.00	1.08
20	603885	吉祥航空	176,578	2,721,066.98	1.08
21	600801	华新水泥	164,200	2,467,926.00	0.98
22	000718	苏宁环球	665,800	2,443,486.00	0.97
23	300037	新宙邦	90,200	2,416,458.00	0.96
24	600073	上海梅林	341,772	2,269,366.08	0.90
25	603708	家家悦	101,700	2,236,383.00	0.89
26	601318	中国平安	35,500	2,079,590.00	0.82
27	002332	仙琚制药	218,800	1,914,500.00	0.76
28	300012	华测检测	323,500	1,856,890.00	0.74
29	002206	海利得	343,107	1,712,103.93	0.68
30	002003	伟星股份	195,974	1,659,899.78	0.66
31	000961	中南建设	260,654	1,644,726.74	0.65
32	000786	北新建材	87,971	1,630,102.63	0.65
33	600919	江苏银行	192,902	1,236,501.82	0.49
34	601229	上海银行	74,195	1,169,313.20	0.46
35	002803	吉宏股份	26,900	911,372.00	0.36
36	600332	白云山	15,800	601,190.00	0.24
37	600233	圆通速递	44,417	586,304.40	0.23
38	600498	烽火通信	20,833	517,700.05	0.21
39	002468	申通快递	27,645	474,111.75	0.19
40	000537	广宇发展	38,789	373,925.96	0.15
41	000681	视觉中国	11,557	331,685.90	0.13
42	603679	华体科技	13,660	301,203.00	0.12

43	600585	海螺水泥	8,729	292,246.92	0.12
44	000338	潍柴动力	22,177	194,048.75	0.08
45	603839	安正时尚	7,056	127,784.16	0.05
46	300091	金通灵	5,355	73,899.00	0.03
47	603157	拉夏贝尔	721	12,365.15	0.00
48	603788	宁波高发	178	4,385.92	0.00
49	002042	华孚时尚	236	1,755.84	0.00
50	002078	太阳纸业	78	755.82	0.00
51	300199	翰宇药业	50	714.00	0.00

#### 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	14,050,998.34	5.57
2	600466	蓝光发展	8,650,250.75	3.43
3	601288	农业银行	8,066,769.00	3.20
4	002327	富安娜	7,202,759.00	2.86
5	603885	吉祥航空	6,253,187.60	2.48
6	000651	格力电器	6,075,653.00	2.41
7	000961	中南建设	6,014,602.94	2.39
8	002293	罗莱生活	5,760,553.15	2.28
9	002146	荣盛发展	5,754,290.12	2.28
10	001979	招商蛇口	5,748,760.54	2.28
11	600919	江苏银行	5,158,871.00	2.05
12	603008	喜临门	5,127,552.59	2.03
13	002003	伟星股份	5,120,209.18	2.03
14	002029	七匹狼	4,831,369.86	1.92
15	601668	中国建筑	4,743,567.00	1.88
16	000786	北新建材	4,697,210.97	1.86

17	601877	正泰电器	4,671,338.00	1.85
18	002024	苏宁易购	4,483,902.00	1.78
19	600176	中国巨石	4,368,235.57	1.73
20	002120	韵达股份	4,312,608.00	1.71

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300199	翰宇药业	3,565,026.46	1.41
2	600919	江苏银行	3,451,970.89	1.37
3	000961	中南建设	3,441,660.44	1.36
4	603839	安正时尚	3,276,765.06	1.30
5	603885	吉祥航空	3,116,130.39	1.24
6	603788	宁波高发	3,068,038.71	1.22
7	002003	伟星股份	3,009,942.97	1.19
8	002078	太阳纸业	2,743,159.51	1.09
9	300684	中石科技	2,574,326.40	1.02
10	603157	拉夏贝尔	2,468,884.06	0.98
11	000786	北新建材	2,453,133.30	0.97
12	603679	华体科技	2,438,475.99	0.97
13	600585	海螺水泥	2,404,025.17	0.95
14	000681	视觉中国	2,385,553.94	0.95
15	300716	国立科技	2,270,951.50	0.90
16	600233	圆通速递	2,256,155.41	0.89
17	002468	申通快递	2,240,720.49	0.89
18	000338	潍柴动力	2,184,586.38	0.87
19	600498	烽火通信	1,688,778.34	0.67
20	002042	华孚时尚	1,646,396.83	0.65

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

买入股票成本（成交）总额	206,019,097.35
卖出股票收入（成交）总额	63,453,846.80

#### 7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,290,136.70	0.91
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	4,882,500.00	1.94
9	其他	-	-
10	合计	7,172,636.70	2.84

#### 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

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	111890118	18广州银行C D005	50,000	4,882,500.0 0	1.94
2	112320	16蓝标债	26,170	2,290,136.7 0	0.91

#### 7.7 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。

#### 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

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

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

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

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 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

#### 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	68,541.07
2	应收证券清算款	72,745,550.35
3	应收股利	-
4	应收利息	140,514.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,954,605.49

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

#### 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
2,990	88,679.16	43,644,591.52	16.46%	221,506,097.96	83.54%

#### 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	-	-

#### 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

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(2018年04月04日)基金份额总额	405,878,750.21
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	71,486.51
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	140,799,547.24
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	265,150,689.48

## § 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：

2018年5月19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督察长变更的公告》，张丽珉女士因已届法定退休年龄离任公司督察长，公司聘任李理想先生为督察长。

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。

### 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为毕马威华振会计师事务所（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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
南京证券	2	112,384,427.51	41.71%	104,663.68	47.67%	-
华泰证券	2	157,088,516.64	58.29%	114,878.83	52.33%	-

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，（40672）华泰证券、（005991）华泰证券、（399775）南京证券、（21677）南京证券为本基金本期新增的交易单元。

### 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		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
南京证券	-	-	962,100,000.00	33.12%	-	-	-	-
华泰证券	2,323,657.64	100.00%	1,942,400,000.00	66.88%	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊及公司网站	2018-04-04
2	关于富安达基金因维护网站、网上交易系统暂停相关业务的公告	公司网站	2018-04-13
3	关于富安达基金网上直销部分招商银行卡业务暂停的通知	公司网站	2018-04-24
4	关于富安达基金系统升级维护的公告	公司网站	2018-05-03
5	富安达基金管理有限公司关于举行2018年投资者网上集体接待日活动的通知	指定报刊及公司网站	2018-05-08
6	关于富安达基金系统升级维护的公告	公司网站	2018-05-11
7	富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定	指定报刊及公司网站	2018-05-16

	额投资业务公告		
8	关于富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金参加部分销售机构定期定额投资及申购基金费率优惠活动的公告	指定报刊及公司网站	2018-05-16
9	关于富安达基金系统升级维护的公告	公司网站	2018-05-17
10	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与银河证券申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	指定报刊及公司网站	2018-05-18
11	富安达基金管理有限公司关于督察长变更的公告	指定报刊及公司网站	2018-05-19
12	关于富安达基金系统升级维护的公告	公司网站	2018-05-25
13	关于富安达基金网上直销部分招商银行卡业务暂停的通知	公司网站	2018-05-29
14	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与建设银行直联网上直销交易定期定额投资手续费率优惠的公告	指定报刊及公司网站	2018-06-01
15	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司手机银行费率优惠活动的公告	指定报刊及公司网站	2018-06-30
16	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊及公司网站	2018-06-30

## § 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

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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金设立的文件：  
《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；  
《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；  
《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
2. 《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
3. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
4. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
5. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
6. 中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.fadfunds.com）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇一八年八月二十九日