富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2020 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。本中期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2020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2020年1月1日起至2020年6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 6
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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
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
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 中期财务会计报告(未经审计) 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
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 46
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 47
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 47
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 47
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 47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 48
§8 基金份额持有人信息 48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 49

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 49
§9 开放式基金份额变动 49
§10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 50
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
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 50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 50
10.8 其他重大事件 56
§11 影响投资者决策的其他重要信息 58
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 58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 58
§12 备查文件目录 58
12.1 备查文件目录 59
12.2 存放地点 59
12.3 查阅方式 59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金
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	54,767,026.97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	李理想	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	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道1568号29楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1568号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		蒋晓刚	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金中期报告备置地点	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

§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（2020年01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	15,496,570.37
本期利润	30,733,557.87
加权平均基金份额本期利润	0.7544
本期加权平均净值利润率	47.66%
本期基金份额净值增长率	57.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	50,679,706.84
期末可供分配基金份额利润	0.9254
期末基金资产净值	116,453,426.52
期末基金份额净值	2.1263
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	112.63%

注：

1．所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2．本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3．期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	23.90%	1.33%	4.21%	0.53%	19.69%	0.80%
过去三个月	44.51%	1.49%	7.30%	0.54%	37.21%	0.95%
过去六个月	57.56%	1.68%	2.42%	0.89%	55.14%	0.79%
过去一年	88.23%	1.42%	8.04%	0.72%	80.19%	0.70%

过去三年	109.34%	1.39%	16.57%	0.74%	92.77%	0.65%
自基金合同生效起至今	112.63%	1.19%	17.05%	0.74%	95.58%	0.45%

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：

Return t =60%×[沪深300指数t÷沪深300指数(t-1)-1]+40%×[中债总财富总指数t÷中债总财富总指数(t-1)-1]

Benchmark t =(1+ Return t)×Benchmark(t-1)

其中，t =1，2，3，…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

§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2020年6月30日，公司共管理十三只开放式基金：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、富安达现金通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、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达科技领航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	-	10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。2015年12月起担任富安达健康人生灵活配置混合型基金、富安达策略精选灵活配置混合型基金的基金经理。
纪青	本基金的基金经理	2016-12-16	-	12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。2016年12月

					起担任富安达健康人生灵活配置混合型基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金。

注：

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遵规守信情况的说明

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

2020年上半年受新冠病毒全球传播影响，A股波动较大，上证指数下跌2.15%,创业板指上涨35.6%，沪深300指数上涨1.64%。我们重点配置在健康最相关的医药行业，结构上我们主要配置了医疗器械、独立医学实验室、临床外包、血液制品、药店等细分行业的龙头上市公司，我们所持有的部分标的受益于新冠疫情传播带来的需求增加，受影响的部分标的经营活动在二季度恢复较快，因此整体业绩跑赢业绩比较基准。

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混合基金份额净值为2.1263元，本报告期内，基金份额净值增长率为57.56%，同期业绩比较基准收益率为2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年一季度国内较好的控制住了疫情，随后即有序开展复工复产，逆周期调节政策继续发力，货币政策维持宽松，二季度国内经济恢复较好。国内经济的恢复对证券市场不利的一点就是货币政策有可能面临微调，同时我们所持有的部分标的估值已经创出历史新高，出现了一定的泡沫化迹象，下半年我们将适当控制仓位，积极配置估值与增长匹配度较好的标的。

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，估值委员会成员由基金经理、以及研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指派人员组成，公司其他高级管理人员可列席参会。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。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，参与估值程度和估值技术的讨论，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权。

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

本基金本报告期未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 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：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	19,106,444.43	6,847,528.26
结算备付金		221,158.88	335,145.86

存出保证金		58,498.90	34,951.05
交易性金融资产	6.4.7.2	96,210,927.74	49,324,200.34
其中：股票投资		93,206,427.74	49,324,200.34
基金投资		-	-
债券投资		3,004,500.00	-
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		-	2,655,800.78
应收利息	6.4.7.5	99,241.78	1,629.79
应收股利		-	-
应收申购款		5,473,912.03	457,586.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		121,170,183.76	59,656,842.63
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
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		2,061,771.42	-
应付赎回款		2,251,094.32	159,288.39
应付管理人报酬		88,104.45	59,074.17
应付托管费		14,684.04	9,845.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	178,530.05	141,521.55
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	122,572.96	50,055.39
负债合计		4,716,757.24	419,785.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	54,767,026.97	43,896,379.06
未分配利润	6.4.7.10	61,686,399.55	15,340,678.36
所有者权益合计		116,453,426.52	59,237,057.42
负债和所有者权益总计		121,170,183.76	59,656,842.63

报告截止日2020年6月30日，基金份额净值2.1263元，基金份额总额54,767,026.97份。

6.2 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：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01日 至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		32,021,875.23	9,240,209.17
1.利息收入		61,423.57	42,406.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,346.78	14,773.90
债券利息收入		33,561.37	25,931.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		515.42	1,700.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		16,265,814.23	3,127,623.79

填列）			
其中：股票投资收益	6.4.7.12	16,114,999.31	2,981,245.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-11,399.99
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	150,814.92	157,778.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,236,987.50	6,060,750.52
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	457,649.93	9,428.71
减：二、费用		1,288,317.36	598,573.94
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	481,972.41	276,685.06
2．托管费	6.4.10.2.2	80,328.71	46,114.23
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	638,014.42	200,897.90
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	6.4.7.20	88,001.82	74,876.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,733,557.87	8,641,635.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,733,557.87	8,641,635.23

6.3 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：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020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)	43,896,379.06	15,340,678.36	59,237,057.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,733,557.87	30,733,557.87
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)	10,870,647.91	15,612,163.32	26,482,811.23
其中：1.基金申购款	72,622,586.35	51,627,984.55	124,250,570.90
2.基金赎回款	-61,751,938.44	-36,015,821.23	-97,767,759.67
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）	54,767,026.97	61,686,399.55	116,453,426.52
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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)	41,847,292.42	-3,391,198.43	38,456,093.99
二、本期经营活动产	-	8,641,635.23	8,641,635.23

生的基金净值变动数(本期利润)			
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)	-10,858,326.11	-1,235,010.51	-12,093,336.62
其中:1.基金申购款	1,669,672.97	126,476.10	1,796,149.07
2.基金赎回款	-12,527,999.08	-1,361,486.61	-13,889,485.69
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)	30,988,966.31	4,015,426.29	35,004,392.60

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:

张睿	孙爱民	孙爱民
————————	————————	————————
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,《富安达健康人生灵活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%，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：沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2020年8月28日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、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6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2020年6月30日的财务状况以及2020年1月1日至2020年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020年06月30日
活期存款	19,106,444.43
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	19,106,444.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		75,850,760.61	93,206,427.74	17,355,667.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,024,000.00	3,004,500.00	-19,500.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,024,000.00	3,004,500.00	-19,500.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		78,874,760.61	96,210,927.74	17,336,167.13

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

本基金本报告期末未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通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	3,255.00
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	89.55
应收债券利息	95,807.67
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	65.80
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	23.76
合计	99,241.78

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 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	178,530.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	178,530.05

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,956.14
应付证券出借违约金	-
预提费用	119,616.82
合计	122,572.96

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,896,379.06	43,896,379.06
本期申购	72,622,586.35	72,622,586.35
本期赎回（以“-”号填列）	-61,751,938.44	-61,751,938.44
本期末	54,767,026.97	54,767,026.97

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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
上年度末	21,970,978.60	-6,630,300.24	15,340,678.36
本期利润	15,496,570.37	15,236,987.50	30,733,557.87
本期基金份额交易产	13,212,157.87	2,400,005.45	15,612,163.32

生的变动数			
其中：基金申购款	52,537,323.87	-909,339.32	51,627,984.55
基金赎回款	-39,325,166.00	3,309,344.77	-36,015,821.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,679,706.84	11,006,692.71	61,686,399.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	24,286.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,590.24
其他	469.96
合计	27,346.78

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	215,995,885.28
减：卖出股票成本总额	199,880,885.97
买卖股票差价收入	16,114,999.31

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	150,814.92
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	150,814.92

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1.交易性金融资产	15,236,987.50
——股票投资	15,256,487.50
——债券投资	-19,500.00
——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	15,236,987.50

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	454,177.77
转换费收入	3,472.16
合计	457,649.93

注：

1．本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的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，其中不低于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 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	638,014.42
银行间市场交易费用	-
合计	638,014.42

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
汇划手续费	385.00
帐户维护费	18,000.00
合计	88,001.82

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司（“南京证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司（“江苏交通”）	基金管理人的股东
南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司（“南京河西”）	基金管理人的股东
富安达资产管理（上海）有限公司（“富安达资管”）	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30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	23,969,887.30	5.44%	-	-

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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的债券交易。

6.4.10.1.4 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的债券回购交易。

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 2020年01月01日至2020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	22,322.94	5.83%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	-	-	-	-

注：

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 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	481,972.41	276,685.06
其中：支付销售机构的客户维护费	134,843.88	91,496.52

注：

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 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	80,328.71	46,114.23

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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 2020年06月30日		上年度末 2019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	6,710,287.90	12.25%	10,616,705.01	24.19%

6.4.10.6 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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	19,106,444.43	24,286.58	7,250,334.00	13,288.45

注：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。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
601816	京沪高铁	2020-01-08	2020-07-16	新股流通锁定	4.88	6.17	460,950	2,249,436.00	2,844,061.50	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	329	5,800.27	5,800.27	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	948	5,631.12	5,631.12	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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。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控制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、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交通银行，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2020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(2019年12月31日：本基金无债券投资)。

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2020年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约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时间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发行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上述比例限制)。

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。于本报告期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,106,444.43	-	-	-	19,106,444.43
结算备付金	221,158.88	-	-	-	221,158.88
存出保证金	58,498.90	-	-	-	58,498.90
交易性金融资产	3,004,500.00	-	-	93,206,427.74	96,210,927.74
应收利息	-	-	-	99,241.78	99,241.78
应收申购款	1,600.40	-	-	5,472,311.63	5,473,912.03
资产总计	22,392,202.61	-	-	98,777,981.15	121,170,183.76
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,061,771.42	2,061,771.42
应付赎回款	-	-	-	2,251,094.32	2,251,094.32
应付管理人报酬	-	-	-	88,104.45	88,104.45
应付托管费	-	-	-	14,684.04	14,684.04
应付交易费用	-	-	-	178,530.05	178,530.05
其他负债	-	-	-	122,572.96	122,572.96

负债总计	-	-	-	4,716,757.24	4,716,757.24
利率敏感度缺口	22,392,202.61	-	-	94,061,223.91	116,453,426.52
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,847,528.26	-	-	-	6,847,528.26
结算备付金	335,145.86	-	-	-	335,145.86
存出保证金	34,951.05	-	-	-	34,951.05
交易性金融资产	-	-	-	49,324,200.34	49,324,200.34
应收证券清算款	-	-	-	2,655,800.78	2,655,800.78
应收利息	-	-	-	1,629.79	1,629.79
应收申购款	3,986.08	-	-	453,600.47	457,586.55
资产总计	7,221,611.25	-	-	52,435,231.38	59,656,842.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	159,288.39	159,288.39
应付管理人报酬	-	-	-	59,074.17	59,074.17
应付托管费	-	-	-	9,845.71	9,845.71
应付交易费用	-	-	-	141,521.55	141,521.55
其他负债	-	-	-	50,055.39	50,055.39
负债总	-	-	-	419,785.21	419,785.21

计					
利率敏感度缺口	7,221,611.25	-	-	52,015,446.17	59,237,057.42

注：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

于2020年6月30日，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2.58%(2019年12月31日：本基金未持有交易性债券)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

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：股票投资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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	93,206,427.74	80.04	49,324,200.34	83.27
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	93,206,427.74	80.04	49,324,200.34	83.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	1.沪深300指数上升5%	4,515,851.42	1,966,062.63
	2.沪深300指数下降5%	-4,515,851.42	-1,966,062.63

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) 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2020年06月30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90,339,605.87元，属于第二层次的余额为5,871,321.87元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次49,318,844.92元，第二层次5,355.42元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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2020年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019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) 除公允价值外，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	93,206,427.74	76.92

	其中：股票	93,206,427.74	76.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,004,500.00	2.48
	其中：债券	3,004,500.00	2.48
	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	19,327,603.31	15.95
8	其他各项资产	5,631,652.71	4.65
9	合计	121,170,183.76	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	47,975,923.60	41.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,587.28	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,793,333.62	12.70
G	交通运输、仓储和邮政业	5,722,261.50	4.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,303,361.74	1.98
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,080,160.00	8.66

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	12,324,800.00	10.58
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	93,206,427.74	80.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

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	603233	大参林	62,000	5,035,640.00	4.32
2	603883	老百姓	50,000	5,002,000.00	4.30
3	688198	佰仁医疗	37,265	4,908,918.45	4.22
4	300723	一品红	105,000	4,524,450.00	3.89
5	600380	健康元	275,000	4,466,000.00	3.84
6	603882	金域医学	48,000	4,296,000.00	3.69
7	002317	众生药业	250,000	4,290,000.00	3.68
8	300759	康龙化成	42,000	4,132,800.00	3.55
9	300347	泰格医药	40,000	4,075,200.00	3.50
10	603259	药明康德	41,000	3,960,600.00	3.40
11	300244	迪安诊断	112,000	3,953,600.00	3.40
12	603799	华友钴业	100,000	3,886,000.00	3.34
13	002223	鱼跃医疗	90,000	3,276,000.00	2.81

14	600998	九州通	171,101	3,185,900.62	2.74
15	300725	药石科技	24,000	2,982,000.00	2.56
16	601816	京沪高铁	460,950	2,844,061.50	2.44
17	300760	迈瑞医疗	9,000	2,751,300.00	2.36
18	300009	安科生物	150,000	2,685,000.00	2.31
19	300609	汇纳科技	62,500	2,293,750.00	1.97
20	600867	通化东宝	120,000	2,091,600.00	1.80
21	300298	三诺生物	60,000	1,928,400.00	1.66
22	688016	心脉医疗	5,256	1,825,198.56	1.57
23	002422	科伦药业	75,000	1,575,000.00	1.35
24	002382	蓝帆医疗	50,000	1,505,500.00	1.29
25	600233	圆通速递	100,000	1,456,000.00	1.25
26	002352	顺丰控股	26,000	1,422,200.00	1.22
27	600976	健民集团	66,900	1,202,193.00	1.03
28	688358	祥生医疗	11,140	1,061,976.20	0.91
29	603127	昭衍新药	10,000	1,051,300.00	0.90
30	600750	江中药业	80,000	1,011,200.00	0.87
31	300676	华大基因	6,000	935,460.00	0.80
32	002007	华兰生物	17,000	851,870.00	0.73
33	000739	普洛药业	25,000	582,250.00	0.50
34	002262	恩华药业	30,000	505,800.00	0.43
35	300073	当升科技	13,000	429,910.00	0.37
36	601607	上海医药	20,000	367,600.00	0.32
37	603707	健友股份	4,500	290,565.00	0.25
38	300363	博腾股份	8,000	276,480.00	0.24
39	600521	华海药业	6,000	203,580.00	0.17
40	300842	帝科股份	440	17,916.80	0.02
41	603087	甘李药业	129	12,938.70	0.01
42	300685	艾德生物	150	11,544.00	0.01
43	300839	N博汇	486	11,377.26	0.01
44	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01

45	600956	新天绿能	1,307	6,587.28	0.01
46	300845	捷安高科	329	5,800.27	0.00
47	300840	酷特智能	948	5,631.12	0.00
48	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	300463	迈克生物	9,249,953.00	15.62
2	002007	华兰生物	6,487,952.66	10.95
3	300003	乐普医疗	5,927,776.00	10.01
4	300244	迪安诊断	5,736,576.02	9.68
5	002422	科伦药业	5,645,590.76	9.53
6	603883	老百姓	5,591,559.90	9.44
7	300298	三诺生物	5,416,305.00	9.14
8	002044	美年健康	5,034,655.00	8.50
9	300760	迈瑞医疗	5,007,976.00	8.45
10	603259	药明康德	4,940,474.00	8.34
11	300347	泰格医药	4,660,372.00	7.87
12	600998	九州通	4,656,684.53	7.86
13	603233	大参林	4,651,982.88	7.85
14	600380	健康元	4,509,839.00	7.61
15	300723	一品红	4,424,437.00	7.47
16	300294	博雅生物	4,161,963.00	7.03
17	600867	通化东宝	4,134,385.96	6.98
18	300142	沃森生物	4,085,321.00	6.90
19	300725	药石科技	3,934,834.00	6.64
20	000538	云南白药	3,874,989.05	6.54
21	603799	华友钴业	3,819,232.00	6.45

22	603939	益丰药房	3,748,023.00	6.33
23	603882	金域医学	3,719,099.00	6.28
24	300759	康龙化成	3,687,244.00	6.22
25	300482	万孚生物	3,619,625.00	6.11
26	002317	众生药业	3,568,172.00	6.02
27	300630	普利制药	3,307,178.00	5.58
28	601816	京沪高铁	3,213,480.00	5.42
29	002859	洁美科技	3,164,917.00	5.34
30	002223	鱼跃医疗	3,154,055.00	5.32
31	300009	安科生物	3,113,823.92	5.26
32	000423	东阿阿胶	2,968,244.00	5.01
33	603658	安图生物	2,917,388.00	4.92
34	002773	康弘药业	2,858,808.50	4.83
35	600285	羚锐制药	2,800,968.00	4.73
36	603127	昭衍新药	2,780,280.00	4.69
37	600438	通威股份	2,715,675.27	4.58
38	601117	中国化学	2,707,300.00	4.57
39	300609	汇纳科技	2,416,410.00	4.08
40	600763	通策医疗	2,396,442.00	4.05
41	603858	步长制药	2,357,163.00	3.98
42	000710	贝瑞基因	2,250,454.00	3.80
43	688198	佰仁医疗	2,182,180.00	3.68
44	300558	贝达药业	2,084,307.00	3.52
45	600521	华海药业	2,069,646.00	3.49
46	300253	卫宁健康	2,008,111.00	3.39
47	688139	海尔生物	1,952,747.87	3.30
48	002304	洋河股份	1,942,849.00	3.28
49	600161	天坛生物	1,865,034.00	3.15
50	002901	大博医疗	1,820,663.00	3.07
51	300653	正海生物	1,806,664.00	3.05
52	002262	恩华药业	1,744,811.18	2.95

53	300326	凯利泰	1,680,641.80	2.84
54	600406	国电南瑞	1,623,272.75	2.74
55	000028	国药一致	1,615,414.00	2.73
56	600436	片仔癀	1,600,272.24	2.70
57	002727	一心堂	1,592,364.00	2.69
58	300529	健帆生物	1,537,395.00	2.60
59	002019	亿帆医药	1,524,848.40	2.57
60	600233	圆通速递	1,471,892.77	2.48
61	002352	顺丰控股	1,412,760.00	2.38
62	002382	蓝帆医疗	1,399,298.00	2.36
63	688016	心脉医疗	1,346,672.08	2.27
64	600976	健民集团	1,311,542.00	2.21

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300463	迈克生物	10,978,793.00	18.53
2	002007	华兰生物	8,138,783.65	13.74
3	002044	美年健康	7,169,120.80	12.10
4	000538	云南白药	6,829,487.00	11.53
5	300298	三诺生物	6,339,103.32	10.70
6	300003	乐普医疗	6,078,737.50	10.26
7	603939	益丰药房	6,045,894.00	10.21
8	603259	药明康德	5,262,618.20	8.88
9	300142	沃森生物	5,188,277.00	8.76
10	300244	迪安诊断	5,016,333.00	8.47
11	300760	迈瑞医疗	4,963,239.00	8.38
12	603883	老百姓	4,660,665.00	7.87

13	002773	康弘药业	4,395,091.68	7.42
14	600436	片仔癀	4,196,859.00	7.08
15	300482	万孚生物	4,171,335.25	7.04
16	603882	金域医学	4,140,208.08	6.99
17	300294	博雅生物	4,137,105.00	6.98
18	300529	健帆生物	4,110,275.00	6.94
19	000661	长春高新	3,915,804.00	6.61
20	300347	泰格医药	3,807,958.33	6.43
21	002422	科伦药业	3,755,244.00	6.34
22	000028	国药一致	3,379,758.00	5.71
23	600196	复星医药	3,321,358.00	5.61
24	300630	普利制药	3,211,142.00	5.42
25	002859	洁美科技	3,176,696.00	5.36
26	603658	安图生物	3,107,313.17	5.25
27	601117	中国化学	2,831,516.00	4.78
28	600285	羚锐制药	2,683,233.00	4.53
29	000423	东阿阿胶	2,674,226.52	4.51
30	600763	通策医疗	2,608,720.00	4.40
31	688139	海尔生物	2,566,369.71	4.33
32	300725	药石科技	2,513,415.00	4.24
33	600438	通威股份	2,499,142.00	4.22
34	600867	通化东宝	2,415,630.42	4.08
35	603858	步长制药	2,412,309.00	4.07
36	300633	开立医疗	2,411,227.00	4.07
37	000710	贝瑞基因	2,275,328.00	3.84
38	603127	昭衍新药	2,254,407.00	3.81
39	603456	九洲药业	2,199,516.80	3.71
40	002901	大博医疗	2,060,955.00	3.48
41	300253	卫宁健康	2,002,000.00	3.38
42	300363	博腾股份	1,999,295.00	3.38
43	300558	贝达药业	1,946,025.00	3.29

44	002304	洋河股份	1,945,117.00	3.28
45	600521	华海药业	1,898,262.00	3.20
46	300653	正海生物	1,890,112.72	3.19
47	600161	天坛生物	1,874,934.00	3.17
48	601607	上海医药	1,851,523.00	3.13
49	300326	凯利泰	1,751,047.84	2.96
50	600406	国电南瑞	1,704,211.00	2.88
51	601398	工商银行	1,676,200.00	2.83
52	600062	华润双鹤	1,598,252.00	2.70
53	600998	九州通	1,576,103.00	2.66
54	002727	一心堂	1,548,209.00	2.61
55	002019	亿帆医药	1,535,446.00	2.59
56	300759	康龙化成	1,534,674.00	2.59
57	601233	桐昆股份	1,520,945.00	2.57
58	688222	成都先导	1,311,182.66	2.21
59	002262	恩华药业	1,279,194.20	2.16
60	601816	京沪高铁	1,232,034.52	2.08

注：“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	228,506,625.87
卖出股票收入（成交）总额	215,995,885.28

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	3,004,500.00	2.58
	其中：政策性金融债	3,004,500.00	2.58
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	3,004,500.00	2.58

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	018007	国开1801	30,000	3,004,500.00	2.58

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 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超出基金合同规定备选股票库之外的情形。

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	58,498.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	99,241.78
5	应收申购款	5,473,912.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,631,652.71

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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§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
12,415	4,411.36	7,407,662.07	13.530%	47,359,364.90	86.470%

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	659,873.03	1.20%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

注：

1．基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为10至50万份（含）。

2．本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为10至50万份（含）。

§9 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	43,896,379.06
本报告期基金总申购份额	72,622,586.35
减：本报告期基金总赎回份额	61,751,938.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,767,026.97

§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：

2020年3月6日,公司股东会解除熊长安同志公司监事会职务，同时聘任林海涛同志担任公司股东监事。

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，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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其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。

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	
安信	1	-	-	-	-	-

证券						
国泰君安	1	15,885,126.28	3.60%	14,793.96	3.86%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	56,444,753.82	12.81%	52,566.93	13.73%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	22,768,617.09	5.17%	21,204.64	5.54%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	26,944,208.61	6.11%	25,093.11	6.55%	-
东兴	2	42,143,173.10	9.56%	39,247.95	10.25%	-

证券						
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	14,426,023.89	3.27%	13,434.95	3.51%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	24,346,485.70	5.52%	22,673.79	5.92%	-
国盛证券	2	18,811,160.60	4.27%	13,756.71	3.59%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	41,521,116.06	9.42%	30,364.56	7.93%	-
南京证券	2	23,969,887.30	5.44%	22,322.94	5.83%	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	33,629,927.85	7.63%	31,319.79	8.18%	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风	2	-	-	-	-	-

证券						
西藏东财	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	42,614,298.72	9.67%	39,686.83	10.36%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	35,588,031.73	8.08%	26,025.40	6.80%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	41,611,830.93	9.44%	30,430.67	7.95%	-

注：

1．为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

（一）财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与公司具有互补性、最近一年内无重大违法违规行为发生；

（二）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（三）能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的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，（009711）光大证券、（390781）开源证券、（46515）开源证券、（007380）上海证券、（45370）上海证券，为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：（004925）西部证券、（48045）中泰证券、（35734）国海证券、（001212）国海证券。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	3,024,000.00	100.00%	5,800,000.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-	-	-

投								
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期未通过交易单元进行权证、基金交易。

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	富安达基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	规定媒介	2020-01-11
2	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2020-01-17
3	富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2019年第4季度报告	规定媒介	2020-01-17
4	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2020-01-21
5	富安达基金管理有限公司关于旗下基金2020年1月31日不开放申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的提示性公告	规定媒介	2020-01-31
6	富安达基金管理有限公司及全资子公司申购旗下偏股型公募基金的公告	规定媒介	2020-02-05
7	富安达基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2020-02-13
8	富安达基金管理有限公司关于参加东海期货有限责任公司基金费率优惠活动的公告	规定媒介	2020-03-06

9	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2020-03-11
10	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2020-03-18
11	富安达基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	规定媒介	2020-03-18
12	富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票“浪潮信息”(000977)、“闻泰科技”(600745)估值调整的公告	规定媒介	2020-03-19
13	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2020-03-27
14	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2020-04-08
15	富安达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	规定媒介	2020-04-10
16	富安达基金管理有限公司关于参加华泰证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告	规定媒介	2020-04-11
17	富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2019年年度报告	规定媒介	2020-04-20
18	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2020-04-20
19	富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金2020年第一季度报告	规定媒介	2020-04-22

20	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2020-04-22
21	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2020-04-23
22	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加中信证券华南股份有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2020-04-30
23	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2020-05-11
24	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2020-05-27
25	富安达基金管理有限公司关于参加北京汇成基金销售有限公司费率优惠的公告	规定媒介	2020-06-08

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101-20200618	10,616,705.01	6,710,287.90	10,616,705.01	6,710,287.90	12.25%
产品特有风险							
当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。							

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健康人生灵活配置混合型证券投资基金设立的文件：

《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

《富安达健康人生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

二〇二〇年八月二十九日