

## 富安达增强收益债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017-06-30

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

报告送出日期：2017-08-24

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

富安达增强收益债券型证券投资基金

基金简称

富安达增强收益债券

场内简称

基金主代码

710301

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2012-07-25

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

44,678,456.99

基金合同存续期

不定期

下属 2 级基金的基金简称

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

710301

710302

报告期末下属 2 级基金的份额总额

20,581,813.55

24,096,643.44

## 基金产品说明

### 投资目标

本基金将在控制风险与保持资产流动性的基础上，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资回报。

### 投资策略

本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、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，判断和预测经济发展周期及趋势，综合比较大类资产的收益及风险情况，确定债券、股票、现金等大类资产配置比例。

在进行固定收益类资产配置时,本基金首先通过久期配置、期限结构配置、类属配置策略来实现对固定收益类资产的配置。本基金的股票类资产作为整体基金投资组合管理的辅助工具，为投资人提供适度参与股票市场、获取超额收益的机会。

### 业绩比较基准

中债总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

### 风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

下属分级基金的风险收益特征

基金管理人和基金托管人

项目

基金管理人

基金托管人

名称

富安达基金管理有限公司

交通银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

蒋晓刚

陆志俊

联系电话

021-61870999

95559

电子邮箱

service@fadfunds.com

luzj@bankcomm.com

客户服务电话

400-630-6999（免长途）021-61870666

95559

传真

021-61870888

021-62701216

注册地址

上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 楼

上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址

上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 楼

上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码



200122

200120

法定代表人

秦雁

牛锡明

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址

[www.fadfunds.com](http://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

其他相关资料

项目

名称

办公地址

会计师事务所

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

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

主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期

报告期(2017-01-01 至 2017-06-30)

富安达增强收益债券

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

本期已实现收益

-1,214,829.88

-1,485,614.4

本期利润

138,100.86

202,424.16

加权平均基金份额本期利润

0.0072

0.0082

本期加权平均净值利润率

-%

0.63 %

0.73 %

本期基金份额净值增长率

-%

0.82 %

0.62 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

富安达增强收益债券

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

期末可供分配利润

2,510,691.88

2,383,907.8

期末可供分配基金份额利润

0.122

0.0989

期末基金资产净值

23,960,782.91

27,474,022.68

期末基金份额净值

1.1642

1.1402

报告期末

报告期末(2017-06-30)

富安达增强收益债券

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

基金份额累计净值增长率

-%

18.7 %

16.26 %

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。

基金净值表现

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 A

阶段

净值增长率①

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

5.82 %

0.72 %

1.4498 %

0.1167 %

4.3702 %

0.6033 %

过去三个月

0.7 %

0.68 %

0.4875 %

0.1286 %

0.2125 %

0.5514 %

过去六个月

0.82 %

0.57 %

0.4578 %

0.1219 %

0.3622 %

0.4481 %

过去一年

-4.51 %

0.58 %

0.9292 %

0.1479 %

-5.4392 %

0.4321 %

过去三年

13.57 %

1.27 %

19.8603 %

0.2128 %

-6.2903 %

1.0572 %

自基金合同生效日起至今（2012年07月25日-2017年06月30日）

18.7 %

1.01 %

23.0212 %

0.1936 %

-4.3212 %

0.8164 %

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 C

阶段

净值增长率①

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

5.79 %

0.72 %

1.4498 %

0.1167 %

4.3402 %

0.6033 %

过去三个月

0.6 %

0.68 %

0.4875 %

0.1286 %

0.1125 %

0.5514 %

过去六个月

0.62 %

0.57 %

0.4578 %

0.1219 %

0.1622 %

0.4481 %

过去一年

-4.9 %

0.58 %

0.9292 %

0.1479 %

-5.8292 %

0.4321 %

过去三年

12.18 %

1.27 %

19.8603 %

0.2128 %

-7.6803 %

1.0572 %

自基金合同生效日起至今（2012年07月25日-2017年06月30日）

16.26 %

1.01 %

23.0212 %

0.1936 %

-6.7612 %

0.8164 %

注：1、本基金业绩比较基准为：10%×沪深 300 指数+90%×中债总财富总指数，

2、本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return } t = 10\% \times [\text{沪深 300 指数 } t / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1] + 90\% \times [\text{中债总财富总指数 } t / \text{中债总财富总指数}(t-1) - 1]$$

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

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

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 A



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 C

注：本基金于 2012 年 7 月 25 日成立。根据《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期为 6 个月，建仓截止日为 2013 年 1 月 24 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

基金管理人及基金经理情况

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新区世纪大道 1568 号中建大厦 29 层，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 6 月 30 日，公司共管理八只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈保本混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金。

#### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

李飞

本基金的基金经理公司固定收益部副总监（主持工作）、投资管理部总监助理（主持工作）

2013-07-04

-

13 年

博士。历任上海应用技术学院财政经济系教师；聚源数据有限责任公司研究发展中心项目经理；国盛证券有限责任公司投资研究部高级宏观债券研究员；金元惠理基金管理有限公司投资部基金经理。2012 年 5 月加入富安达基金管理有限公司。2013 年 7 月起任富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理（2013 年 10 月 25 日至 2016 年 10 月 25 日期间）、富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、任职日期和离任日期均指公司做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。

#### 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、《富安达增强收益债券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。

#### 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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。

#### 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

## 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年上半年海外经济延续复苏，美联储两次加息，推动货币政策正常。中国经济则稳中有进，益于较为强劲的国内消费和海外复苏对净出口的拉动，上半年GDP增速为6.9%，较上年略有回升。PMI指数连续9个月保持在51之上，经济触底回升迹象显著；而通胀数据分化，代表上游的工业品出厂价格指数PPI摆脱了连续四年的负增长，同比数据大幅走高，推动了周期性行业的盈利增长；食品价格走软，居民消费品价格指数CPI波澜不惊，整体上在2%之下徘徊。我国政府继续实施中性的货币政策和积极的财政政策，大力推进去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板为主导的供给侧改革。从防止资产泡沫和维护金融稳定的大局出发，一行三会推出了一系列金融监管措施；而央行也逐步收紧市场流动性，引导利率水平缓慢上行；证监会新股发行提速，限制定增和跨界重组等行为，一系列政策的出台显著改变了市场预期。中小银行和非银机构的负债成本大幅走高，债券市场收益率较为紊乱。存单收益和一级市场发债成本高企，债券和社融融资金额大幅萎缩。国债收益率大幅走高且收益率曲线倒挂，1年期短端收益率高出10年期长端收益率，信用违约事件时有发生，受定增新规影响，上市公司转债发行预案发布较多，信用利差也显著扩大。这一局面直到5月下旬，央行适时提前公告MLF续作计划，安抚市场，打消了市场对跨季钱荒的预期，同时金融监管力度和节奏也有所舒缓。债市买盘踊跃，债券收益率大幅下行，收益率曲线略有修复。股票市场则结构显著风化，A股成功加入MSCI以及陆港通北上资金的推动，市场回归价值投资理念，以家电白酒为代表的大盘消费类龙头蓝筹股票持续大涨；而TMT等依靠外生并购的小盘成长股则连续阴跌。本基金一季度受到债券市场大幅下跌的影响，净值波动较大；二季度及时转变投资策略，并抓住五月后市场反弹的机遇，加大了符合政策导向的资产和行业的配置，取得了一定的效果。

## 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，富安达增强收益债券 A 基金份额净值为 1.1642 元，本报告期净值增长率为 0.82%；富安达增强收益债券 C 基金份额净值为 1.1402 元，本报告期净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准增长率为 0.46%。

#### 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为资金供需将维持紧平衡，大幅波动的可能性较低，中国经济仍在旧产能周期底部徘徊；叠加主动去杠杆，经济增速或将走低，预计明年二季度 PPI 将再次降到负增长区域。随着实体经济回报率下降，驱动货币利率向下，因此整体上利好债券。我们的观点，债券资产中，利率债最值得配置，而信用债还需仔细甄别质地，转债随着供给品种的增加和信用打新方式的改变，也值得积极配置。在估值压力下降，供求关系改善，无风险利率的下行，流动性边际改善的情况下，权益表现应该不差，其中受益于政策导向的新型产业和消费类产业值得重点关注。

#### 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。

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期末进行收益分配。

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



#### 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

本报告期内，本基金自 2017 年 1 月 10 日至 3 月 21 日共计连续 48 个工作日基金净值低于 5000 万，2017 年 3 月 22 日起基金规模高于 5000 万；自 2017 年 5 月 5 日至 6 月 16 日共计连续 30 个工作日基金净值低于 5000 万，2017 年 6 月 19 日起基金规模高于 5000 万。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

#### 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年上半年度，基金托管人在富安达增强收益债券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。

托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017 年上半年度，富安达基金管理有限公司在富安达增强收益债券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。

托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 年上半年度，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增强收益债券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。

资产负债表

会计主体：富安达增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

资产：

银行存款

108,244.38

299,433.49

结算备付金

1,240,583.81

1,865,936.06

存出保证金

29,925.64

21,057.58

交易性金融资产

65,743,031.85

54,943,424.32

其中：股票投资

10,053,588

9,753,604

基金投资

-

-

债券投资

55,689,443.85

45,189,820.32

资产支持证券投资

-

-

贵金属投资

-

-

衍生金融资产

-

-

买入返售金融资产

-

-

应收证券清算款

1,310,212.54

404,241.7

应收利息

202,602.77

226,584.05

应收股利

-

-

应收申购款

41,513.44

5,527.35

递延所得税资产

-

-

其他资产

-

-

资产总计

68,676,114.43

57,766,204.55

负债和所有者权益

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

负债：

短期借款

-

-

交易性金融负债

-

-

衍生金融负债

-

-



卖出回购金融资产款

15,500,000

7,000,000

应付证券清算款

196,248.07

254,670.19

应付赎回款

242,087.46

8,352.29

应付管理人报酬

28,759.9

28,045.36

应付托管费

8,217.14

8,012.97

应付销售服务费

8,771.06

10,224.16

应付交易费用

309,754.42

159,355.73

应交税费

519,918.4

519,918.4

应付利息

-4,466.87

324.15

应付利润

-

-

递延所得税负债

-

-

其他负债

432,019.26

495,006.18

负债合计

17,241,308.84

8,483,909.43

所有者权益:

-

-

实收基金

44,678,456.99

43,212,924.61

未分配利润

6,756,348.6

6,069,370.51

所有者权益合计

51,434,805.59

49,282,295.12

负债和所有者权益总计

68,676,114.43

57,766,204.55

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，富安达增强收益 A 类基金份额净值 1.1642 元，富安达增强收益 C 类基金份额净值 1.1402 元；富安达增强收益基金份额总额 44,678,456.99 份（其中 A 类 20,581,813.55 份，C 类 24,096,643.44 份）。

利润表

会计主体：富安达增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

一、收入

1,146,369.7

-7,294,639.83

1.利息收入

358,970.9

816,155.26

其中：存款利息收入

11,661.63

34,242.27

债券利息收入

347,309.27

781,912.99

资产支持证券利息收入

-

-

买入返售金融资产收入

-

-

其他利息收入

-

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

-2,254,994.95

-4,575,537.75

其中：股票投资收益

-966,048.78

-1,151,617.5

基金投资收益

-

-

债券投资收益

-1,391,783.27

-3,441,577.07

资产支持证券投资收益

-



-

贵金属投资收益

-

-

衍生工具收益

-

-

股利收益

102,837.1

17,656.82

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）

3,040,969.3

-3,543,780.42

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）

-

-

5.其他收入（损失以“-”号填列）

1,424.45

8,523.08

减：二、费用

805,844.68

1,066,760.2

1. 管理人报酬

171,567.07

168,922.62

2. 托管费

49,019.22

48,263.67

3. 销售服务费

54,785.12

64,879.74

4. 交易费用

273,014.51

332,472.51

5. 利息支出

172,353

424,175.53

其中：卖出回购金融资产支出

172,353

424,175.53

6. 其他费用

85,105.76

28,046.13

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

340,525.02

-8,361,400.03

减：所得税费用

-

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

340,525.02

-8,361,400.03

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

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）

43,212,924.61

6,069,370.51

49,282,295.12

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

340,525.02

340,525.02

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）

1,465,532.38

346,453.07

1,811,985.45

其中：1.基金申购款

15,060,774.05

2,440,400.17

17,501,174.22

2.基金赎回款

-13,595,241.67

-2,093,947.1

-15,689,188.77

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）

44,678,456.99

6,756,348.6

51,434,805.59

项目

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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）

39,689,509.11

16,793,519.45

56,483,028.56



二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

-8,361,400.03

-8,361,400.03

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）

-382,516.56

-345,173.61

-727,690.17

其中：1.基金申购款

30,169,736.13

7,129,686.66

37,299,422.79

2.基金赎回款

-30,552,252.69

-7,474,860.27

-38,027,112.96

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）

43,212,924.61

6,069,370.51

49,282,295.12

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署；

基金管理人负责人：蒋晓刚      主管会计工作负责人：沈伟青      会计机构负责人：  
顾颖

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

## 报表附注

### 基金基本情况

富安达增强收益债券型证券投资基金(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[2012]677号《增强收益债券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《富安达增强收益债券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 606,170,350.17 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 258 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 606,269,167.85 份基金份额,其中认购资金利息折合 98,817.68 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(以下"交通银行")。

根据《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》和《富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金自募集期起根据认购费、申购费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费的,称为 A 类基金份额;不收取认购费、申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不

能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达增强收益债券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，包括债券、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、银行存款、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，但须符合中国证监会的相关规定。本基金主要投资于国债、政策金融债、央行票据、地方政府债、商业银行金融债与次级债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购等固定收益品种。本基金可投资股票、权证等权益类资产。本基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类品种投资比例不超过基金资产的 20%。本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准：中债总指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

#### 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》、《富安达增强收益债券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。

## 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 重要会计政策和会计估计

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。

## 会计年度

-

## 记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-

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的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明



本基金本报告期无会计政策变更。

会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公

司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) [适用于2016年5月1日前成立的基金]于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

活期存款

108,244.38

-

定期存款

-

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

-

其他存款

-

-

合计

108,244.38

299,433.49

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

成本

公允价值

公允价值变动

股票

10,351,047.18

10,053,588

-297,459.18

贵金属投资-金交所黄金合约

-

-

-

债券

交易所市场

58,958,642.64

55,689,443.85

-3,269,198.79

银行间市场

-

-

-

合计

58,958,642.64

55,689,443.85

-3,269,198.79

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

69,309,689.82

65,743,031.85

-3,566,657.97

项目

上年度末

2016-12-31

成本

公允价值

公允价值变动



股票

-

-

-

贵金属投资-金交所黄金合约

-

-

-

债券

交易所市场

-

-

-

银行间市场

-

-

-

合计

-

-

-

资产支持证券

-

-

-

基金

-

-

-

其他

-

-

-

合计

-

-

-

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

### 货币衍生工具

-

-

-

-

### 权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

项目

上年度末

2016-12-31

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-



-

-

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

合计

0

0

项目

上年度末

2016-12-31

账面余额

其中：买断式逆回购

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入反售金融资产。

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

项目

上年度末

2016-12-31

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：本基金本报告期末及上年度末未通过买断式逆回购交易取得债券。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应收活期存款利息

293.75

-

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

502.47

-

应收债券利息

201,794.49

-

应收买入返售证券利息

-

-

应收申购款利息

-

-

应收黄金合约拆借孳息

-

-

其他

12.0599999999977

-

合计

202,602.77

226,584.05

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

其他应收款

-

-



待摊费用

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

交易所市场应付交易费用

309,754.42

-

银行间市场应付交易费用

-

-

合计

309,754.42

159,355.73

其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应付券商交易单元保证金

-

-

应付赎回费

173.5

-

预提费用

431,845.76

-

合计

432,019.26

495,006.18

实收基金

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

基金份额（份）

账面金额

基金份额（份）

账面金额

上年度末

14,582,725.95

14,582,725.95

28,630,198.66

28,630,198.66

本期申购

12,217,848.75

12,217,848.75

2,842,925.3

2,842,925.3

本期赎回（以“-”号填列）

-6,218,761.15

-6,218,761.15

-7,376,480.52

-7,376,480.52

本期末

20,581,813.55

20,581,813.55

24,096,643.44

24,096,643.44

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

未分配利润

富安达增强收益债券 A

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

2,668,182.13

-412,061.44

2,256,120.69

本期利润

-1,214,829.88

1,352,930.74

138,100.86



本期基金份额交易产生的变动数

1,057,339.63

-72,591.82

984,747.81

其中：基金申购款

2,133,728.66

-96,981.28

2,036,747.38

基金赎回款

-1,076,389.03

24,389.46

-1,051,999.57

本期已分配利润

-

-

-

本期末

2,510,691.88

868,277.48

3,378,969.36

富安达增强收益债券 C

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

4,609,228.18

-795,978.36

3,813,249.82

本期利润

-1,485,614.4

1,688,038.56

202,424.16

本期基金份额交易产生的变动数

-739,705.98

101,411.24

-638,294.74

其中：基金申购款

366,555.87

37,096.92

403,652.79

基金赎回款

-1,106,261.85

64,314.32

-1,041,947.53

本期已分配利润

-

-

-

本期末

2,383,907.8

993,471.44

3,377,379.24

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

活期存款利息收入

1,989.65

-

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

9,475.34

-

其他

196.64

-

合计

11,661.63

34,242.27

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出股票成交总额

102,646,780.8

-

减：卖出股票成本总额

103,612,829.58

-

买卖股票差价收入



-966,048.78

-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

-1,391,783.27

-

债券投资收益——赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

-

-

合计

-1,391,783.27

-3,441,577.07

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

90,144,753.23

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

91,080,233.76

-

减：应收利息总额

456,302.74

-

买卖债券差价收入

-1,391,783.27

-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

赎回基金份额对价总额

-

-

减：现金支付赎回款总额

-

-

减：赎回债券成本总额

-

-

减：赎回债券应收利息总额

-

-

赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-

申购差价收入

-

-



资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

资产支持证券投资收益

-

-

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出权证成交总额

-

-

减：卖出权证成本总额

-

-

买卖权证差价收入

-

-

注：本基金本报告期内及上年度均未获得衍生工具收益。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间收益金额

2016-01-01 至 2016-06-30

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资产生的股利收益

102,837.1

-

基金投资产生的股利收益

-

-

合计

102,837.1

17,656.82

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

3,040,969.3

-

——股票投资

881,858.81

-

——债券投资

2,159,110.49

-

——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

-

-

合计

3,040,969.3

-3,543,780.42

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

基金赎回费收入

1,412.5

-

基金转换费收入

11.95

-

合计

1,424.45

8,523.08

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，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，其中转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

交易所市场交易费用

273,014.51

-

银行间市场交易费用

-

-

合计

273,014.51

332,472.51

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

审计费用

29,752.78

-

信息披露费

37,092.98

-

其他

200

-

帐户维护费

18,000

-

汇划手续费

60

-

合计

85,105.76

28,046.13

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

关联方关系

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。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

南京证券股份有限公司（"南京证券"）

0

0%

98,746,117.40

100 %

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

南京证券股份有限公司（"南京证券"）

0

0%

33,506,094.20

56.47%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

南京证券股份有限公司（"南京证券"）

0

0%

1,187,031,000.00

100 %

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易业务。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30



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

南京证券股份有限公司

0

0%

0

0%

关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

南京证券股份有限公司

91,962.35

45.27 %

0

0 %

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。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

171,567.07

168,922.62

其中：支付销售机构的客户维护费

28,954.29

41,490.50

注：1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 ×0.7% / 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。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

49,019.22

48,263.67

注：1.支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期发生的基金应支付的销售服务费

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

合计

富安达基金管理有限公司

-

29,342.63

29,342.63

交通银行股份有限公司

-

5,940.67

5,940.67

南京证券股份有限公司

-

12,194.22

12,194.22

合计

-

47,477.52

47,477.52

获得销售服务费的各关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期应支付的销售服务费

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

合计

富安达基金管理有限公司

-

12,751.28

12,751.28

交通银行股份有限公司

-

27,739.53

27,739.53

南京证券股份有限公司

-



13,626.95

13,626.95

合计

-

54,117.76

54,117.76

注：1.支付基金销售机构的增强收益 C 类销售服务费按前一日增强收益 C 类基金资产净值 0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给富安达基金，再由富安达基金计算并支付给各基金销售机构。增强收益 A 类不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费=前一日增强收益 C 类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

各关联方投资本基金的情况

报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

份额级别

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

基金合同生效日（2012-07-25）持有的基金份额

-

-

-

-

期初持有的基金份额

-

4,873,456.05

-

-

期间申购/买入总份额

-

-

-

-

期间因拆分增加的份额

-

-

-

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

-

-

-

期末持有的基金份额

-

4,873,456.05

-

4,873,456.05

期末持有的基金份额占基金总份额比例

-%

10.91 %

-%

-%

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

项目

富安达增强收益债券 A

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

2,419,728.92

5.42 %

2,419,728.92

16.59 %

项目

富安达增强收益债券 C

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

7,695,267.41

17.22 %

7,695,267.41

26.88 %

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

期末余额

当期利息收入

期末余额

当期利息收入

交通银行活期存款

108,244.38

1,989.65

317,191.56

2,640.46

注：1、本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。2017年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2016年6月30日：同）。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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。

利润分配情况

利润分配情况——非货币市场基金富安达增强收益债券 A

单位：人民币元

序号

权益登记日

除息日

每 10 份基金份额分红数

现金形式发放总额

再投资形式发放总额

本期利润分配合计

备注

利润分配情况——非货币市场基金富安达增强收益债券 C

单位：人民币元

序号

权益登记日

除息日

每 10 份基金份额分红数

现金形式发放总额

再投资形式发放总额

本期利润分配合计

备注

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券

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

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

受限证券类别：债券

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

注：本基金本期末未持有因认购新股/新债而于期末流通受限的证券。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码

股票名称

停牌日期

停牌原因

期末估值单价

复牌日期

复牌开盘单价

数量（股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

300100

双林股份

2017-04-05

重大资产重组

25.96

-

-

30,000.00

826,707.18

778,800.00

-

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-

金额单位：人民币元

债券代码

债券名称

回购到期日

期末估值单价

数量（张）

期末估值总额

注：本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 15,500,000 元（共 1 笔），于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## 金融工具风险及管理

-

### 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动管理型债券型基金，属于中低风险品种。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，运用理性分析价值，严格控制风险，通过积极的主动管理优化基金的风险与收益，为投资人带来长期稳定的回报。

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。

## 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，与该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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元



短期信用评级

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

A-1

-

-

A-1 以下

-

-

未评级

2,843,936.40

2,494,860.00

合计

2,843,936.40

2,494,860.00

注： 未评级债券为国债。

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

AAA

13,902,614.50

12,986,684.50

AAA 以下

38,942,892.95

29,708,275.82

未评级

-

-

合计

52,845,507.45

42,694,960.32

### 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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%。本基金所持大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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变

现。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。

#### 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额



-

上年度末  
2016-12-31

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

流动性净额

-

## 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。

## 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

## 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1 年以内

1-5 年

5 年以上

不计息

合计

资产

银行存款

108,244.38

0

0

0

108,244.38

结算备付金

1,240,583.81

0

0

0

1,240,583.81

存出保证金



29,925.64

0

0

0

29,925.64

交易性金融资产

55,689,443.85

0

0

10,053,588

65,743,031.85

应收证券清算款

0

0

0

1,310,212.54

1,310,212.54

应收利息

0

0

0

202,602.77

202,602.77

应收申购款

0

0

0

41,513.44

41,513.44

资产总计

57,068,197.68

-

-

11,607,916.75

68,676,114.43

负债

卖出回购金融资产款

15,500,000

0

0

0

15,500,000

应付证券清算款

0

0

0

196,248.07

196,248.07

应付赎回款

0

0

0

242,087.46

242,087.46

应付管理人报酬

0

0

0

28,759.9

28,759.9

应付托管费



0

0

0

8,217.14

8,217.14

应付销售服务费

0

0

0

8,771.06

8,771.06

应付交易费用

0

0

0

309,754.42

309,754.42

应交税费

0

0

0

519,918.4

519,918.4

应付利息

0

0

0

-4,466.87

-4,466.87

其他负债

0

0

0

432,019.26

432,019.26

负债总计

15,500,000

-

-

1,741,308.84

17,241,308.84

利率敏感度缺口

41,568,197.68

-

-

9,866,607.91

51,434,805.59

上年度末

2016-12-31

1 年以内

1-5 年

5 年以上

不计息

合计

资产

银行存款

299,433.49

0

0

0

299,433.49



结算备付金

1,865,936.06

0

0

0

1,865,936.06

存出保证金

21,057.58

0

0

0

21,057.58

交易性金融资产

45,189,820.32

0

0

9,753,604

54,943,424.32

应收证券清算款

0

0

0

404,241.7

404,241.7

应收利息

0

0

0

226,584.05

226,584.05

应收申购款

0

0

0

5,527.35

5,527.35

资产总计

47,376,247.45

-

-

10,389,957.1

57,766,204.55

负债

卖出回购金融资产款

7,000,000

0

0

0

7,000,000

应付证券清算款

0

0

0

254,670.19

254,670.19

应付赎回款

0

0

0



8,352.29

8,352.29

应付管理人报酬

0

0

0

28,045.36

28,045.36

应付托管费

0

0

0

8,012.97

8,012.97

应付销售服务费

0

0

0

10,224.16

10,224.16

应付交易费用

0

0

0

159,355.73

159,355.73

应交税费

0

0

0

519,918.4

519,918.4

应付利息

0

0

0

324.15

324.15

其他负债

0

0

0

495,006.18

495,006.18

负债总计

7,000,000

-

-

1,483,909.43

8,483,909.43

利率敏感度缺口

40,376,247.45

-

-

8,906,047.67

49,282,295.12

注：本表所示为本基金生息资产及负债的公允价值，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。

### 利率风险的敏感性分析

#### 假设

1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。

2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。

3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。

#### 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

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

利率上升 25 个基点

-26,341.72

18,606.81

利率下降 25 个基点

26,535.41

-18,494.03

注：截至报告期末，本基金未持有受重大利率风险影响的投资品种。

## 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

项目

上期末

2016-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

## 外汇风险的敏感性分析

假设

-

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

## 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。

本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、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，判断和预测经济发展周期及趋势，综合比较大类资产的收益及风险情况，确定债券、股票、现金等大类资产配置比例。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。本基金投资组合中债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类品种投资比例不超过基金资产的 20%。本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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。

## 其他价格风险敞口



金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

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

10,053,588

19.55

9,753,604

19.79

交易性金融资产—基金投资

-

-

-

-

交易性金融资产—债券投资

0

0

0

0

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

10,053,588

19.55

9,753,604

19.79

其他价格风险的敏感性分析

假设

1、估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。

2、假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。

3、Beta 系数是根据组合在报表日股票持仓资产在过去 100 个交易日与其对应的指数数据回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

5%

-

-

-5%

-

-

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 19.55%(2016 年 12 月 31 日：19.79%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

采用风险价值法管理风险

-

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号



项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益类投资

10,053,588

14.64

其中：股票

10,053,588

14.64

2

固定收益投资

55,689,443.85

81.09

其中：债券

55,689,443.85

81.09

资产支持证券

-

-

3

贵金属投资

-

-

4

金融衍生品投资

-

-

5

买入返售金融资产

-

-

其中：买断式回购的买入返售金融资产

-

-

6

银行存款和结算备付金合计

1,348,828.19

1.96

7

其他各项资产

1,584,254.39

2.31

8

合计

68,676,114.43

100

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

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

1,527,710

2.97

B

采矿业

-

-

C

制造业

8,254,078

16.05

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

-

-

**G**

交通运输、仓储和邮政业

-

-

**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

271,800

0.53

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

-

-

## 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

-

-

S

综合

-

-

合计

10,053,588

19.55

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

600066

宇通客车

69,200

1,520,324

2.96

2

002048

宁波华翔

51,000

1,063,860

2.07

3

002458

益生股份

50,000

1,032,500

2.01

4

300121

阳谷华泰

67,500

931,500

1.81

5

000333

美的集团

20,000

860,800

1.67

6

300100

双林股份

30,000

778,800

1.51

7

600803

新奥股份

51,400

706,236

1.37

8

300410

正业科技

18,000

649,800

1.26

9

000063

中兴通讯

26,200

621,988

1.21

10

002273

水晶光电

30,000

618,900

1.2



11

002746

仙坛股份

17,000

495,210

0.96

12

300648

星云股份

10,000

476,600

0.93

13

600816

安信信托

20,000

271,800

0.53

14

603043

广州酒家

1,000

25,270

0.05

报告期内股票投资组合的重大变动

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

300121

阳谷华泰

4,302,462.13

8.73

2

600889

南京化纤

3,908,948.35

7.93

3

601881

中国银河

3,398,548

6.9

4

600066

宇通客车

1,945,038

3.95

5

600720

祁连山

1,910,914

3.88

6

000789

万年青

1,794,298.58

3.64

7

601668

中国建筑

1,698,665

3.45

8

002048

宁波华翔

1,625,078

3.3

9

300100

双林股份

1,621,999

3.29

10

000625

长安汽车

1,605,823.02

3.26

11

600425

\*ST 青松

1,582,260

3.21

12

603005

晶方科技

1,579,277

3.2

13

300207

欣旺达

1,457,145

2.96

14

002284

亚太股份

1,453,245

2.95

15



600545

新疆城建

1,434,615

2.91

16

300303

聚飞光电

1,405,929.96

2.85

17

600338

西藏珠峰

1,371,295

2.78

18

002273

水晶光电

1,345,600

2.73

19

600104

上汽集团

1,338,271

2.72

20

002258

利尔化学

1,321,771.6

2.68

21

600075

新疆天业

1,303,123

2.64

22

002002

鸿达兴业

1,278,968

2.6

23

002643

万润股份

1,276,156

2.59

24

000970

中科三环

1,176,400

2.39

25

002636

金安国纪

1,141,992.08

2.32

26

300082

奥克股份

1,134,969

2.3

27

002458

益生股份

1,128,500

2.29

28

603816

顾家家居

1,128,145

2.29

29

000801

四川九洲

1,075,249

2.18

30

300166

东方国信

1,071,406

2.17

31

002108

沧州明珠

1,067,637

2.17

32

000930

中粮生化

1,067,332

2.17

33

600667

太极实业

1,062,788

2.16

34

300375

鹏翎股份

1,058,847.98

2.15

35

601186

中国铁建

1,055,967

2.14

36

300335

迪森股份

1,014,985

2.06



注：1、“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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（%）

600889

南京化纤

3,924,965.41

7.96

2

601881

中国银河

3,502,847

7.11

3

300121

阳谷华泰

3,023,754.22

6.14

4

600720

祁连山

2,099,450

4.26

5

600104

上汽集团

2,030,675

4.12

6

000789

万年青

1,914,556.6

3.88

7

601668

中国建筑

1,680,435

3.41

8

000625

长安汽车

1,624,500

3.3

9

600425

\*ST 青松

1,612,000

3.27

10

002108

沧州明珠

1,595,554

3.24

11

603005

晶方科技

1,584,285

3.21

12

300207

欣旺达

1,472,038

2.99

13

002284

亚太股份

1,458,548

2.96

14

600545

新疆城建

1,454,555

2.95

15

300303

聚飞光电

1,423,500

2.89

16

600338

西藏珠峰

1,416,952

2.88

17

002002

鸿达兴业

1,365,675

2.77

18

002258

利尔化学

1,330,615

2.7

19

600075

新疆天业

1,326,314

2.69

20

002643



万润股份

1,301,915

2.64

21

002068

黑猫股份

1,290,400

2.62

22

000970

中科三环

1,213,660

2.46

23

002636

金安国纪

1,163,171

2.36

24

603816

顾家家居

1,142,460

2.32

25

300166

东方国信

1,101,090

2.23

26

601186

中国铁建

1,099,700

2.23

27

600110

诺德股份

1,088,042

2.21

28

000930

中粮生化

1,079,770.66

2.19

29

600667

太极实业

1,065,965.99

2.16

30

300082

奥克股份

1,058,957

2.15

31

300335

迪森股份

1,017,628.92

2.06

32

601689

拓普集团

998,469

2.03

33

000546

金圆股份

991,670

2.01

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。

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

103,030,954.77

卖出股票收入（成交）总额

102,646,780.8

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。

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

2,843,936.4

5.53

2

央行票据

-

-

3

金融债券

-

-

其中：政策性金融债

-

-

4



企业债券

6,341,061.74

12.33

5

企业短期融资券

-

-

6

中期票据

-

-

7

可转债（可交换债）

46,504,445.71

90.41

8

同业存单

-

-

9

其他

-

-

10

合计

55,689,443.85

108.27

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（元）

占基金资产净值比例（%）

1

132006

16 皖新 EB

44,500

4,714,330

9.17

2

113009

广汽转债

37,830

4,677,679.5

9.09

3

128010

顺昌转债

36,000

4,217,400

8.2

4

110034

九州转债

31,000

3,923,050

7.63

5

113012

骆驼转债

34,720

3,719,900.8

7.23

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值

公允价值变动

风险说明

公允价值变动总额合计

-

股指期货投资本期收益

-



股指期货投资本期公允价值变动

-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

-

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

-

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-

国债期货投资本期收益（元）

-

国债期货投资本期公允价值变动(元)

-

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

-

投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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

29,925.64

2

应收证券清算款

1,310,212.54

3

应收股利

-

4

应收利息

202,602.77

5

应收申购款

41,513.44

6

其他应收款

-

7

待摊费用

-

8

其他

-

9

合计

1,584,254.39

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号

债券代码

债券名称

公允价值

占基金资产净值比例（%）

1

132006

16 皖新 EB

4,714,330

9.17

2

113009

广汽转债

4,677,679.5

9.09

3

128010

顺昌转债



4,217,400

8.2

4

110034

九州转债

3,923,050

7.63

5

110033

国贸转债

3,540,758

6.88

6

132001

14 宝钢 EB

3,333,150

6.48

7

128011

汽模转债

3,122,042

6.07

8

132003

15 清控 EB

2,157,960

4.2

9

113010

江南转债

1,897,628.4

3.69

10

110030

格力转债

1,703,550

3.31

11

120001

16 以岭 EB

1,662,300

3.23

12

113008

电气转债

1,428,075

2.78

13

127003

海印转债

569,240

1.11

14

128013

洪涛转债

202,600

0.39

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

300100

双林股份

778,800

1.51

重大资产重组

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。

期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别

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

富安达增强收益债券 A

1,015

20,277.65

2,428,417.29

11.8 %

18,153,396.26

88.2 %

富安达增强收益债券 C

915

26,335.13

12,589,295.74



52.25 %

11,507,347.7

47.75 %

合计

1,930

23,149.46

15,017,713.03

33.61 %

29,660,743.96

66.39 %

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

项目

份额级别

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

富安达增强收益债券 A

0

0%

富安达增强收益债券 C

0

0%

合计

0

0%

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

份额级别

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

富安达增强收益债券 A

0

富安达增强收益债券 C

0

合计

0

本基金基金经理持有本开放式基金

富安达增强收益债券 A

0

富安达增强收益债券 C

0

合计

0

注：1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为 0。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为 0。

发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-

-%

-

-%

-

基金管理人高级管理人员

-

-%

-

-%

-

基金经理等人员

-

-%

-

-%

-

基金管理人股东

-

-%

-

-%

-

其他

-

-%

-

-%

-

合计

-

-%

-

-%

-

开放式基金份额变动



单位：份

项目

富安达增强收益债券

富安达增强收益债券 A

富安达增强收益债券 C

基金合同生效日（2012-07-25）的基金份额总额

-

204,823,108.94

401,446,058.91

本报告期期初基金份额总额

-

14,582,725.95

28,630,198.66

本报告期期间基金总申购份额

-

12,217,848.75

2,842,925.3

减：本报告期期间基金总赎回份额

-

6,218,761.15

7,376,480.52

本报告期期间基金拆分变动份额

-

-

-

本报告期期末基金份额总额

44,678,456.99

20,581,813.55

24,096,643.44

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。

基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动：

2017年1月16日，基金管理人发布《富安达基金管理有限公司关于副总经理离任的公告》，朱龙芳女士因已届法定退休年龄离任公司副总经理。

2017年2月23日，基金管理人在公司召开职工董事人选举大会，选举吴战峰先生代表公司全体职工担任富安达基金管理有限公司董事会职工董事。职工董事变更事项已上报中国证监会。

2017年3月23日，基金管理人发布《富安达基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》，公司聘任沈伟青先生为副总经理。

2017年4月21日，基金管理人因原独立董事赵曙明、陈良华、马维勇任职期届满，在南京召开2016年度股东会，选举赵顺龙、刘健、江涛为公司第三届董事会独立董事。独立董事变更事项已上报中国证监会。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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。

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。

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）。

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。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

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

成交金额

占当期基金成交总额的比例

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

佣金

占当期佣金总量的比例

安信证券

1

70,953,677.47

34.5 %

-

-%

32,700,388.53

17.52 %

0

0 %

0

0 %

51,888.75

34.5 %

-

国信证券

1

36,724,973.72



17.86 %

-

-%

72,223,661.5

38.7 %

614,100,000

50.97 %

0

0 %

26,856.88

17.86 %

-

华金证券

1

12,081,856

5.87 %

-

-%

39,400,493.8

21.11 %

219,600,000

18.23 %

0

0 %

8,835.56

5.87 %

-

西藏东财

2

85,898,198.38

41.77 %

-

-%

42,304,121.61

22.67 %

371,100,000

30.8 %

0

0 %

62,817.5

41.77 %

-

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：

(1) 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；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

(5) 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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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、本报告期新增券商交易单元 38262（华金证券）。本期没有剔除的券商交易单元。

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 2016 年 12 月 31 日基金净值公告

指定报刊和公司网站

2017-01-03

2

富安达基金管理有限公司关于副总经理离任的公告

指定报刊和公司网站

2017-01-16

3

富安达增强收益债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

指定报刊和公司网站

2017-01-20

4

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申购及定期定额投资手续费率优惠的公告

指定报刊和公司网站

2017-02-23

5

富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构及参与其费率优惠活动的公告

指定报刊和公司网站

2017-03-01

6

富安达增强收益债券型证券投资基金更新招募说明书（二〇一七年第一号）

公司网站

2017-03-10

7

富安达增强收益债券型证券投资基金更新招募说明书（二〇一七年第一号）摘要

指定报刊和公司网站

2017-03-10

8

富安达基金管理有限公司关于副总经理任职的公告

指定报刊和公司网站

2017-03-23

9

富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告

指定报刊和公司网站

2017-03-27

10

富安达增强收益债券型证券投资基金 2016 年年度报告

公司网站

2017-03-27

11

富安达增强收益债券型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

指定报刊和公司网站

2017-03-27

12

富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加一路财富（北京）信息科技股份有限公司  
为代销机构及参与其费率优惠活动的公告

指定报刊和公司网站

2017-04-14



13

富安达增强收益债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

指定报刊和公司网站

2017-04-21

14

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申购及定期定额投资手续费率优惠的公告

指定报刊和公司网站

2017-04-24

15

富安达基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司基金费率优惠活动的公告

指定报刊和公司网站

2017-05-17

16

富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与江苏银行基金定投及电子银行渠道申购费率优惠推广活动的公告

指定报刊和公司网站

2017-06-13

17

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申购及定期定额投资手续费率优惠的公告

指定报刊和公司网站

2017-06-30

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

20170101-20170630

10,114,996.33

0

0

10,114,996.33

22.64 %

个人

1

20170322-20170630

0

10,029,526.94

0

10,029,526.94

22.45 %

产品特有风险

-

影响投资者决策的其他重要信息

无

备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准富安达增强收益债券型证券投资基金设立的文件

12.1.2 《富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

12.1.3 《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》

12.1.4 《富安达增强收益债券型证券投资基金托管协议》

12.1.5 《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》

12.1.6 基金管理人业务资格批件和营业执照

12.1.7 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.1.8 中国证监会要求的其他文件

#### 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。

#### 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](http://www.fadfunds.com)）查阅。