

---

# 富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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2021年8月27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2021年1月1日起至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.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 中期财务会计报告(未经审计).....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
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.....	50
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60

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.....	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金
基金简称	富安达长三角区域主题混合
基金主代码	010746
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月22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	159,441,972.60份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金主要投资于注册地在长三角地区的上市公司股票，在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，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健增值。</p>
投资策略	<p>本基金的投资策略分为两方面：一方面体现在采取“自上而下”的方式对权益类、固定收益类等不同类别资产进行大类配置；另一方面体现在对单个投资品种的精选上。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	<p>中证长三角领先指数收益率*70%+中债总指数收益率*30%</p>
风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，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</p>

	基金。
--	-----

注：本基金原业绩比较基准为：中证长三角一体化发展主题指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%，修改后的业绩比较基准为：中证长三角领先指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%，修改后的业绩比较基准生效日为2021年3月24日。

### 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
	联系电话	021-61870999
	电子邮箱	service@fadfunds.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156 8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156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码	200122	200336
法定代表人	张睿	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	《上海证券报》
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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	16,166,708.96
本期利润	44,011,682.47
加权平均基金份额本期利润	0.1263
本期加权平均净值利润率	12.43%
本期基金份额净值增长率	16.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	13,775,039.22
期末可供分配基金份额利润	0.0864
期末基金资产净值	186,488,211.43
期末基金份额净值	1.1696
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	16.96%

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。
4. 本基金《基金合同》生效日为2020年12月22日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

#### 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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	11.78%	1.41%	-1.23%	0.44%	13.01%	0.97%
过去三个月	19.87%	1.20%	2.01%	0.50%	17.86%	0.70%
过去六个月	16.38%	1.44%	-0.48%	0.83%	16.86%	0.61%
自基金合同生效起至今	16.96%	1.39%	0.85%	0.83%	16.11%	0.56%

注：

1. 本基金业绩比较基准为：70%×中证长三角领先指数+30%×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：

$$\text{Return}_t = 70\% \times [\text{中证长三角领先指数}_t \div \text{中证长三角领先指数}_{(t-1)} - 1] + 30\% \times [\text{中债总指数}_t \div \text{中债总指数}_{(t-1)} - 1]$$

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

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

3. 本基金原业绩比较基准为：中证长三角一体化发展主题指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%，修改后的业绩比较基准为：中证长三角领先指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%，修改后的业绩比较基准生效日为2021年3月24日。

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



富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年12月22日-2021年06月30日)



注：

- ①本基金《基金合同》生效日为2020年12月22日，截至本报告期末，基金成立未满1年。
- ②根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2021年6月21日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。
- ③本基金原业绩比较基准为：中证长三角一体化发展主题指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%，修改后的业绩比较基准为：中证长三角领先指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%，修改后的业绩比较基准生效日为2021年3月24日。

## § 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。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。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2021年06月30日，公司共管理十六只开放式基金：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、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、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新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		
吴战峰	本基金的基金经理、公司投资研究部总监	2020-12-22	-	26年	硕士。历任中大投资公司投资部经理，平安证券资产管理部投资经理，招商证券研发中心高级分析师，国信证券研究所首席分析师，国投瑞银基金高级组合经理，国泰基金基金经理，天治基金基金经理、总经理助理兼研究总监。2015年10月加入富安达基金管理有限公司任投资研究部总监。2016年1月起任富安达优势成长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、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合

					型发起式证券投资基金、富安达长三角区域主题混合型发起式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作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《富安达长三角区域主题混合型发起式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

2021年上半年年初，A股市场延续2020年四季度的热点，在光伏、电动汽车产业链、CXO、医疗服务、集成电路等行业的带动下不断走高，但在二月中，受美债收益率快速

上升的影响，A股市场特别是近两年涨幅较大的核心股票出现了持续的下跌，部分股票跌幅较大，A股市场在四月份美债收益率企稳后开始逐步上行，上半年整体呈现震荡的走势，但行业、个股分化巨大，其中医疗服务、CXO、光伏、电动汽车、集成电路等行业表现非常突出。

本基金在2021年上半年重点投资了集成电路、电子元器件、高端制造、人工智能、医药及医疗服务等长三角区域内优势行业的核心公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达长三角区域主题混合基金份额净值为1.1696元，本报告期内，基金份额净值增长率为16.38%，同期业绩比较基准收益率为-0.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2021年下半年，我们预计国内可能保持稳健但相对宽松的货币政策，国家也在积极推动脱虚向实、产业升级、科技创新，整体上看，宏观环境比较有利于股票市场，但同时我们也认为市场分化依然存在，市场整体可能继续维持震荡的格局，这对投资管理工作提出了更高的要求，也需要我们投研团队更加积极深入产业、公司调研，主动分析市场变化，及时调整投资策略，争取进一步提高投资业绩。

我们投资的重点是在长三角区域的优势产业中寻找处于高成长期企业，我们看好生物制药、集成电路、电子、人工智能、高端制造等行业的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，估值委员会成员由基金经理、以及投资研究部、固定收益部、多资产投资部、监察稽核部和基金事务部指定指派人员担任委员组成，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，但需参加估值小组会议；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

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 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长三角区域主题混合型发起式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长三角区域主题混合型发起式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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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长三角区域主题混合型发起式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：富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,758,078.19	207,529,382.71

结算备付金		880,915.26	-
存出保证金		423,402.89	-
交易性金融资产	6.4.7.2	181,398,060.99	192,076,527.80
其中：股票投资		174,376,360.99	192,076,527.80
基金投资		-	-
债券投资		7,021,700.00	-
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	-	110,000,000.00
应收证券清算款		1,806,884.47	-
应收利息	6.4.7.5	126,618.03	44,040.35
应收股利		-	-
应收申购款		114,892.57	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		207,508,852.40	509,649,950.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<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		7,097,139.29	7,662,373.46
应付赎回款		12,964,781.73	-
应付管理人报酬		319,615.29	184,106.70
应付托管费		53,269.20	30,684.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	459,197.17	176,306.40

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	126,638.29	4,133.40
负债合计		21,020,640.97	8,057,604.41
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	159,441,972.60	499,120,884.93
未分配利润	6.4.7.10	27,046,238.83	2,471,461.52
所有者权益合计		186,488,211.43	501,592,346.45
负债和所有者权益总计		207,508,852.40	509,649,950.86

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.1696元，基金份额总额159,441,972.60份。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
<b>一、收入</b>		50,146,643.19
1. 利息收入		227,349.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	101,263.55
债券利息收入		28,411.87
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		97,674.00
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,902,117.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,739,602.97

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	217,517.48
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
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	1,944,997.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	27,844,973.51
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	1,172,202.57
<b>减：二、费用</b>		6,134,960.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,656,474.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	442,745.68
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,960,925.71
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.52
7. 其他费用	6.4.7.20	74,814.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		44,011,682.47
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		44,011,682.47

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年01月01日至2021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)	499,120,884.93	2,471,461.52	501,592,346.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,011,682.47	44,011,682.47
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)	-339,678,912.33	-19,436,905.16	-359,115,817.49
其中：1. 基金申购款	25,189,776.87	545,552.33	25,735,329.20
2. 基金赎回款	-364,868,689.20	-19,982,457.49	-384,851,146.69
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)	159,441,972.60	27,046,238.83	186,488,211.43

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

富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金（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”）《关于准予富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]1597号）批准，由富安达基金管理有限公司（以下简称“富安达基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2020年12月22日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规

模为499,120,884.93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（以下简称“交通银行”）。

本基金自2020年12月7日至2020年12月18日止期间公开发售。本基金首次向社会公开发售募集且扣除认购费用后的有效认购资金人民币499,094,607.54元（含孳生利息人民币26,277.39元），折合499,120,884.93份基金份额，划入基金份额持有人账户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则，《富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金基金合同》和《富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于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（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（股指期货、国债期货等）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相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为50%–95%，其中投资于长三角区域主题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、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金原业绩比较基准为：中证长三角一体化发展主题指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%，修改后的业绩比较基准为：中证长三角领先指数收益率\*70%+中债总指数收益率\*30%，修改后的业绩比较基准生效日为2021年3月24日。

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2021年8月27日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。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〈年度和中期报告〉》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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021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 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。

##### 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。

本基金持有的股票投资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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具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，在资金实际占用期间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/负债、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，在资金实际占用期间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无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《富安达富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，每一基金份额享有同等分配权，收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，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；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。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 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[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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、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]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营业税和企业所得税。

(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日以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；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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) 对基金从上市公司取得的股票的股息、红利所得，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，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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按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。

(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) 对投资者从证券投资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，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。



## 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	
	2021年06月30日	
活期存款	22,758,078.19	
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	22,758,078.19	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	143,751,288.29	174,376,360.99	30,625,072.70	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	7,037,800.00	7,021,700.00	-16,100.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,037,800.00	7,021,700.00	-16,100.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	150,789,088.29	181,398,060.99	30,608,972.70	

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/ 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

本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

##### 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任何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 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,936.13
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	356.76
应收债券利息	124,151.23
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	2.37
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	171.54
合计	126,618.03

注：其他为应收存出保证金利息。

#### 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
----	-----

	2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	459,197.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	459,197.17

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	47,690.35
应付证券出借违约金	-
预提费用	78,947.94
合计	126,638.29

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	499,120,884.93	499,120,884.93
本期申购	25,189,776.87	25,189,776.87
本期赎回（以“-”号填列）	-364,868,689.20	-364,868,689.20
本期末	159,441,972.60	159,441,972.60

注：申购含转换入份额；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	-292,537.67	2,763,999.19	2,471,461.52
本期利润	16,166,708.96	27,844,973.51	44,011,682.47
本期基金份额交易产	-2,099,132.07	-17,337,773.09	-19,436,905.16

生的变动数			
其中：基金申购款	122,946.36	422,605.97	545,552.33
基金赎回款	-2,222,078.43	-17,760,379.06	-19,982,457.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,775,039.22	13,271,199.61	27,046,238.83

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	59,899.95
定期存款利息收入	21,550.03
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,501.87
其他	2,311.70
合计	101,263.55

注：其他为应收申购款利息收入和存出保证金利息收入。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	1,007,239,177.97
减：卖出股票成本总额	988,499,575.00
买卖股票差价收入	18,739,602.97

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转	217,517.48

股及债券到期兑付) 差价收入	
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	217,517.48

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,251,767.07
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,034,100.00
减：应收利息总额	149.59
买卖债券差价收入	217,517.48

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金在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

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金在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 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,944,997.24
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	1,944,997.24

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	27,844,973.51
——股票投资	27,861,073.51
——债券投资	-16,100.00
——资产支持证券投资	-
——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	27,844,973.51

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	1,171,761.78
转换费收入	440.79
合计	1,172,202.57

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 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	2,960,925.71
银行间市场交易费用	-
合计	2,960,925.71

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	26,547.27
信息披露费	48,267.27
证券出借违约金	-
合计	74,814.54

**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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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**

2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，基金管理人股东江苏交通控股有限公司将其持有的本公司26%股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。

**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

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 2021年01月01日至2021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	1,270,902,412.72	65.35%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

##### 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 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例



		例		
南京证券	1,183,591.27	66.99%	-	-

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
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,656,474.27
其中：支付销售机构的客户维护费	1,049,441.39

注：支付基金管理人富安达基金管理有限公司的基金管理费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。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	442,745.68

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。计算公式为：

日基金托管费=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

本基金在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 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

份额单位：份

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金合同生效日（2020年12月22日）持有的基金份额	10,009,083.42
报告期初持有的基金份额	10,009,083.42
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,009,083.42
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.28%

##### 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 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南京证券	5,999,083.33	3.76%	9,999,083.33	2%

## 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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	22,758,078.19	59,899.95

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

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

## 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

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

## 6.4.12 期末（2021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
688345	博力威	2021-06-03	2021-12-13	科创板打新限售	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-
688425	铁建重工	2021-06-11	2021-12-22	科创板打新限售	2.87	4.75	27,172	77,983.64	129,067.00	-

				售						
688667	菱电电控	2021-03-03	2021-09-13	科创板打新限售	75.42	103.88	1,135	85,601.70	117,903.80	-
688070	纵横股份	2021-02-02	2021-08-10	科创板打新限售	23.16	34.47	2,407	55,746.12	82,969.29	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	1,521	59,090.85	59,090.85	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打新限售	47.33	251.96	179	8,472.07	45,100.84	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	1,777	39,022.92	39,022.92	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	231	6,532.68	26,729.01	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	创业板打新限售	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-

3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	创业 板打 新限 售	7.64	38.8 3	462	3,52 9.68	17,9 39.4 6	-
3009 81	中红 医疗	2021 -04- 19	2021 -10- 27	创业 板打 新限 售	48.5 9	90.3 9	198	9,62 0.82	17,8 97.2 2	-
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3009 82	苏文 电能	2021 -04- 19	2021 -10- 27	创业 板打 新限 售	15.8 3	45.2 9	317	5,01 8.11	14,3 56.9 3	-
3009 40	南极 光	2021 -01- 27	2021 -08- 03	创业 板打 新限 售	12.7 6	43.3 8	307	3,91 7.32	13,3 17.6 6	-
3006 14	百川 畅银	2021 -05- 18	2021 -11- 25	创业 板打 新限 售	9.19	40.3 8	329	3,02 3.51	13,2 85.0 2	-
3009 68	格林 精密	2021 -04- 06	2021 -10- 15	创业 板打 新限 售	6.87	12.0 7	1,063	7,30 2.81	12,8 30.4 1	-
3009 42	易瑞 生物	2021 -02- 02	2021 -08- 09	创业 板打 新限 售	5.31	28.5 2	443	2,35 2.33	12,6 34.3 6	-
3009 97	欢乐 家	2021 -05- 26	2021 -12- 02	创业 板打 新限	4.94	13.0 5	928	4,58 4.32	12,1 10.4 0	-

				售						
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板打新限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	创业板打新限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	创业板打新限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	创业板打新限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300948	冠中生态	2021-02-	2021-08-	创业板打	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-

		18	25	新限售						
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	创业板打新限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	创业板打新限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	创业板打新限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	创业板打新限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
3009	博亚	2021	2021	创业	18.2	28.2	245	4,46	6,93	-

71	精工	-04-07	-10-15	板打 新限售	4	9		8.80	1.05	
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	创业 板打 新限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	创业 板打 新限售	24.90	24.81	265	6,598.50	6,574.65	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业 板打 新限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	创业 板打 新限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业 板打 新限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	创业 板打 新限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业 板打 新限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业 板打 新限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-



				售						
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	创业板打新限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打新限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	创业板打新限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打新限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	创业板打新限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
3010	晶雪	2021	2021	创业	7.83	17.6	218	1,70	3,83	-

10	节能	-06-09	-12-20	板打 新限 售		1		6.94	8.98	
----	----	--------	--------	---------------	--	---	--	------	------	--

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	因刊登重要事项公告	56.35	2021-07-01	59.49	273,000	6,718,174.78	15,383,550.00	-

#### 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债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构和部门，建立起包含三个层次的严密、全面、有效的风险控制体系：部门和岗位层面上，以部门内控、部门互控、岗位自控和岗位互控等方式构成了第一级风险控制；监察稽核部对各部门、各机构、各岗位、各项业务中的风险控制情况实施监督，构成了第二级风险控制；合规与风险控制委员会、督察长和风险控制委员会作为公司风险控制的领导机构，侧重于对风险的宏观控制，是整个风险控制体系中的第三个层次。

监察稽核部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各部门、各机构、各岗位、各项业务中的风险控制情况实施监督。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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设定流动性比例要求，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的投资品种比例等。

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%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市，因此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。

##### 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的证券不得超过该证券的10%。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。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。

于2021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。

#### 6.4.13.4 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。

本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。本基金的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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金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进行了分类：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2021年06月30日					
资产					
银行存款	22,758,078.19	-	-	-	22,758,078.19
结算备付金	880,915.26	-	-	-	880,915.26
存出保证金	423,402.89	-	-	-	423,402.89
交易性金融资产	7,021,700.00	-	-	174,376,360.99	181,398,060.99
应收证券清算款	-	-	-	1,806,884.47	1,806,884.47
应收利息	-	-	-	126,618.03	126,618.03
应收申购款	298.21	-	-	114,594.36	114,892.57
资产总计	31,084,394.55	-	-	176,424,457.85	207,508,852.40
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,097,139.29	7,097,139.29
应付赎回款	-	-	-	12,964,781.73	12,964,781.73
应付管理人报酬	-	-	-	319,615.29	319,615.29
应付托管费	-	-	-	53,269.20	53,269.20
应付交易费用	-	-	-	459,197.17	459,197.17
其他负债	-	-	-	126,638.29	126,638.29
负债总计	-	-	-	21,020,640.97	21,020,640.97
利率敏感度缺口	31,084,394.55	-	-	155,403,816.88	186,488,211.43
上年度末 2020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	207,529,382.71	-	-	-	207,529,382.71
交易性金融资产	-	-	-	192,076,527.80	192,076,527.80
买入返售金融资产	110,000,000.00	-	-	-	110,000,000.00
应收利息	-	-	-	44,040.35	44,040.35
资产总计	317,529,382.71	-	-	192,120,568.15	509,649,950.86
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,662,373.46	7,662,373.46
应付管理人报酬	-	-	-	184,106.70	184,106.70
应付托管费	-	-	-	30,684.45	30,684.45
应付交易费用	-	-	-	176,306.40	176,306.40
其他负债	-	-	-	4,133.40	4,133.40
负债总计	-	-	-	8,057,604.41	8,057,604.41
利率敏感度缺口	317,529,382.71	-	-	184,062,963.74	501,592,346.45

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021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3.77%（2020年12月31日：本基金未持有交易性债券投资），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020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

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于6月30日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 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 2021年06月30日		上年度末 2020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	174,376,360.99	93.51	192,076,527.80	38.29
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	174,376,360.99	93.51	192,076,527.80	38.29

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证长三角领先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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 中证长三角领先指数 上升5%	8,159,069.93	3,677,305.12
	2. 中证长三角领先指数 下降5%	-8,159,069.93	-3,677,305.12

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2021年6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173,257,791.24元，第二层次的余额为8,140,269.75元，无属于第三层次的余额。(2020年12月31日：第一层次192,076,527.80元，无属于第二及第三层次的余额。)

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020年12月31日：无)。

##### 6.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具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之间无重大差异。

## § 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	174,376,360.99	84.03
	其中：股票	174,376,360.99	84.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,021,700.00	3.38
	其中：债券	7,021,700.00	3.38
	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	23,638,993.45	11.39
8	其他各项资产	2,471,797.96	1.19
9	合计	207,508,852.40	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	11,290.28	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	101,559,759.26	54.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	6,990,602.67	3.75
G	交通运输、仓储和邮政业	790,000.00	0.42

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,325,755.24	28.59
J	金融业	34,721.10	0.02
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	11,586,810.00	6.21
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.02
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	174,376,360.99	93.51

### 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	300613	富瀚微	111,020	17,305,797.60	9.28
2	600460	士兰微	273,000	15,383,550.00	8.25
3	002230	科大讯飞	221,000	14,935,180.00	8.01
4	002262	恩华药业	618,728	9,497,474.80	5.09
5	600699	均胜电子	350,000	8,932,000.00	4.79
6	300642	透景生命	100,700	8,641,067.00	4.63
7	002415	海康威视	131,000	8,449,500.00	4.53
8	300347	泰格医药	40,500	7,828,650.00	4.20
9	002859	洁美科技	249,980	7,816,874.60	4.19

10	688198	佰仁医疗	33,928	7,735,584.00	4.15
11	688188	柏楚电子	15,000	6,540,000.00	3.51
12	688065	凯赛生物	60,000	6,293,400.00	3.37
13	603236	移远通信	35,000	5,971,350.00	3.20
14	300474	景嘉微	58,200	5,698,944.00	3.06
15	688099	晶晨股份	50,000	5,610,000.00	3.01
16	300316	晶盛机电	90,000	4,545,000.00	2.44
17	300327	中颖电子	50,000	4,261,500.00	2.29
18	002780	三夫户外	236,655	4,141,462.50	2.22
19	603259	药明康德	24,000	3,758,160.00	2.02
20	000997	新大陆	200,000	3,318,000.00	1.78
21	600570	恒生电子	30,000	2,797,500.00	1.50
22	600406	国电南瑞	120,000	2,788,800.00	1.50
23	002221	东华能源	253,481	2,775,616.95	1.49
24	002371	北方华创	10,000	2,773,800.00	1.49
25	605003	众望布艺	62,500	1,460,625.00	0.78
26	600557	康缘药业	128,400	1,443,216.00	0.77
27	000581	威孚高科	51,210	1,066,704.30	0.57
28	601018	宁波港	200,000	790,000.00	0.42
29	603811	诚意药业	14,000	242,900.00	0.13
30	002171	楚江新材	20,000	174,600.00	0.09
31	688161	N威高	1,311	139,031.55	0.07
32	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.07
33	688425	铁建重工	27,172	129,067.00	0.07
34	688667	菱电电控	1,135	117,903.80	0.06
35	688070	纵横股份	2,407	82,969.29	0.04
36	688499	利元亨	1,521	59,090.85	0.03
37	300782	卓胜微	100	53,750.00	0.03
38	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
39	300957	贝泰妮	179	45,100.84	0.02
40	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02

41	688087	英科再生	1,777	39,022.92	0.02
42	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
43	300973	立高食品	231	26,729.01	0.01
44	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
45	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
46	301015	N百洋	462	17,939.46	0.01
47	300981	中红医疗	198	17,897.22	0.01
48	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
49	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
50	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
51	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
52	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
53	300968	格林精密	1,063	12,830.41	0.01
54	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
55	603171	N税友	637	12,230.40	0.01
56	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.01
57	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
58	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
59	300996	普联软件	241	10,177.43	0.01
60	300956	英力股份	371	9,571.80	0.01
61	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
62	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
63	301016	N雷尔伟	275	9,069.50	0.00
64	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
65	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
66	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
67	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
68	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
69	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
70	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
71	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00

72	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
73	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
74	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
75	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
76	300985	致远新能	265	6,574.65	0.00
77	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
78	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
79	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
80	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
81	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
82	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
83	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
84	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
85	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
86	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
87	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
88	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
89	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
90	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	300613	富瀚微	40,554,655.76	8.09
2	002415	海康威视	38,805,766.40	7.74
3	002859	洁美科技	38,634,866.52	7.70
4	600406	国电南瑞	37,378,203.86	7.45
5	000581	威孚高科	35,901,478.17	7.16
6	603259	药明康德	31,342,969.00	6.25

7	002698	博实股份	28,302,693.55	5.64
8	002236	大华股份	25,803,540.00	5.14
9	002353	杰瑞股份	25,549,109.52	5.09
10	000338	潍柴动力	23,622,522.00	4.71
11	002230	科大讯飞	23,381,630.00	4.66
12	600519	贵州茅台	21,412,975.00	4.27
13	688777	中控技术	20,622,301.25	4.11
14	002085	万丰奥威	20,465,479.00	4.08
15	002493	荣盛石化	19,711,590.00	3.93
16	600703	三安光电	19,237,365.00	3.84
17	601231	环旭电子	18,279,785.00	3.64
18	605009	豪悦护理	17,308,197.00	3.45
19	600031	三一重工	17,137,081.50	3.42
20	600018	上港集团	16,257,415.00	3.24
21	603501	韦尔股份	15,981,285.00	3.19
22	002221	东华能源	15,781,115.59	3.15
23	002648	卫星石化	15,726,130.00	3.14
24	600346	恒力石化	15,372,936.00	3.06
25	000301	东方盛虹	14,550,165.00	2.90
26	002056	横店东磁	14,195,151.80	2.83
27	601607	上海医药	13,937,037.93	2.78
28	600000	浦发银行	12,780,678.00	2.55
29	600009	上海机场	11,592,998.00	2.31
30	600276	恒瑞医药	11,298,422.26	2.25
31	603236	移远通信	10,798,045.32	2.15
32	688111	金山办公	10,779,193.00	2.15
33	600104	上汽集团	10,695,827.28	2.13
34	000725	京东方 A	10,065,000.00	2.01

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	600460	士兰微	41,439,488.66	8.26
2	601607	上海医药	40,900,332.92	8.15
3	600406	国电南瑞	36,877,914.60	7.35
4	002415	海康威视	35,015,149.00	6.98
5	300613	富瀚微	34,717,998.90	6.92
6	002221	东华能源	31,159,083.96	6.21
7	000581	威孚高科	31,051,441.06	6.19
8	002859	洁美科技	30,151,602.07	6.01
9	603259	药明康德	29,710,251.26	5.92
10	002698	博实股份	28,488,203.37	5.68
11	002444	巨星科技	26,461,641.37	5.28
12	000338	潍柴动力	25,203,176.20	5.02
13	002353	杰瑞股份	24,412,026.98	4.87
14	002236	大华股份	22,899,856.00	4.57
15	002493	荣盛石化	22,158,796.00	4.42
16	605009	豪悦护理	21,724,864.00	4.33
17	600519	贵州茅台	21,517,607.00	4.29
18	600276	恒瑞医药	20,772,299.96	4.14
19	601231	环旭电子	20,645,455.00	4.12
20	600703	三安光电	19,953,006.00	3.98
21	688777	中控技术	18,619,431.58	3.71
22	002085	万丰奥威	18,097,335.00	3.61
23	002001	新和成	17,111,945.00	3.41
24	000301	东方盛虹	17,008,475.32	3.39
25	600018	上港集团	16,440,836.14	3.28
26	600346	恒力石化	15,819,821.00	3.15
27	600305	恒顺醋业	15,090,214.00	3.01
28	002648	卫星石化	14,761,170.00	2.94



29	603501	韦尔股份	14,413,059.55	2.87
30	605099	共创草坪	14,081,079.72	2.81
31	002262	恩华药业	13,717,590.64	2.73
32	002056	横店东磁	13,387,256.00	2.67
33	300373	扬杰科技	13,314,252.32	2.65
34	600000	浦发银行	13,080,220.00	2.61
35	600031	三一重工	11,616,634.00	2.32
36	601100	恒立液压	10,902,916.00	2.17
37	000425	徐工机械	10,708,637.00	2.13
38	600009	上海机场	10,651,466.00	2.12
39	002230	科大讯飞	10,510,686.90	2.10
40	688111	金山办公	10,454,011.02	2.08
41	000725	京东方 A	10,182,000.00	2.03

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	942,938,334.68
卖出股票收入（成交）总额	1,007,239,177.97

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	7,021,700.00	3.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,021,700.00	3.77

#### 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	019645	20国债15	70,000	7,021,700.00	3.77

#### 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股票库。

## 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	423,402.89
2	应收证券清算款	1,806,884.47
3	应收股利	-
4	应收利息	126,618.03
5	应收申购款	114,892.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,471,797.96

## 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

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	600460	士兰微	15,383,550.00	8.25	停牌

## 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
2,184	73,004.57	17,243,347.12	10.81%	142,198,625.48	89.19%

## 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	303,408.86	0.19%

## 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	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10万份至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0。

## 8.4 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	10,009,083.42	6.28%	10,009,083.42	6.28%	自合

					同 生 效 之 日 起 不 少 于 3 年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,009,083.42	6.28%	10,009,083.42	6.28%	自 合 同 生 效 之 日 起 不 少 于 3 年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年12月22日)基金份额总额	499,120,884.93
----------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	499,120,884.93
本报告期基金总申购份额	25,189,776.87
减：本报告期基金总赎回份额	364,868,689.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	159,441,972.60

## § 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，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 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

本基金的审计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

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	单元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	59,353,642.04	3.05%	43,405.36	2.46%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	66,737,966.00	3.43%	48,805.79	2.76%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

长江 证券	2	96,481,698.73	4.96%	70,558.92	3.99%	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	-	-	-	-	-
东吴 证券	2	-	-	-	-	-
东兴 证券	2	41,899,066.21	2.15%	39,021.78	2.21%	-
光大 证券	2	144,199,534.30	7.41%	134,293.15	7.60%	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华福 证券	2	-	-	-	-	-
华金 证券	2	-	-	-	-	-
华龙 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
开源	2	-	-	-	-	-



证券						
南京证券	2	1,270,902,412.72	65.35%	1,183,591.27	66.99%	-
上海证券	2	210,244,138.01	10.81%	195,803.63	11.08%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	54,992,239.15	2.83%	51,214.21	2.90%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-

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）券商席位由投资研究部业务人员推荐，经投资研究部、固定收益部、多资产投资

部会议讨论，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) 投资研究部、固定收益部、多资产投资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，(011542) 华安证券和(48977) 华安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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	20,000,00 0.00	6.25%	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

华安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	300,000,00 0.00	93.7 5%	-	-	-	-
上海证 券	8,289,56 7.07	100.0 0%	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未通过交易单元进行权证交易、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参加国金证券费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-01-16
2	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参加农业银行费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-01-29
3	富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金基金开放日常申购（赎回转换定期定额投资）业务公告	规定媒介	2021-01-30
4	关于富安达长三角区域主题混合型发起式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	规定媒介	2021-01-30
5	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-02-06
6	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	2021-02-24
7	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-03-01
8	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	2021-03-03
9	富安达基金管理有限公司关于暂停通过建设银行直联办理网上交易部分业务的通知	规定媒介	2021-03-05

10	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加和耕传承为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-03-10
11	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	2021-03-11
12	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	2021-03-24
13	富安达基金管理有限公司关于变更富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金业绩比较基准并相应修订基金合同的公告	规定媒介	2021-03-24
14	富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-03-24
15	富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金基金合同	规定媒介	2021-03-24
16	富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金招募说明书(更新) (二〇二一年第一号)	规定媒介	2021-03-24
17	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	2021-04-08
18	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	2021-04-21
19	富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金2021年第1季度报告	规定媒介	2021-04-21
20	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加财咨道信息	规定媒介	2021-04-26

	技术有限公司为销售机构并与其费率优惠活动的公告		
21	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-28
22	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	2021-05-07
23	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加泛华普益为销售机构的公告	规定媒介	2021-05-18
24	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金暂停参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-05-19
25	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加万得基金为销售机构的公告	规定媒介	2021-05-26
26	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-04
27	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京钱景基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-07
28	富安达基金管理有限公司关于参加上海万得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-07
29	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	2021-06-16
30	富安达基金管理有限公司关	规定媒介	2021-06-18

	于系统升级暂停服务的公告		
31	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海爱建基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-25

## § 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  
无。

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、中国证监会准予富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金注册的文件：《富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金招募说明书》；《富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金基金合同》；《富安达长三角区域主题混合型发起式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](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日