

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金 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

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

基金简称

富安达健康人生混合

场内简称

基金主代码

001861

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2015-11-25

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

144,218,453.49

基金合同存续期

基金产品说明

投资目标

本基金通过资产的灵活配置,重点投资于能够满足人们对优质健康生活需求的上市公司,在有效控制风险的前提下,力争为投资者带来长期稳定的超额收益。

投资策略

本基金采用自上而下的富安达多维经济模型,通过对全球经济发展形势,国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析,结合 FED 模型,对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测,并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型,辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。一般情况下,本基金将大部分基金资产投资于健康人生主题下的上市公司证券,当证券市场系统性风险加大时,本基金将对相关证券资产的配置比例做出适时调整。

业绩比较基准

沪深 300 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%

风险收益特征

本基金属于混合型证券投资基金，一般情况，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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

021-51870888

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

《上海证券报》、《证券日报》

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址

www.fadfunds.com

基金年度报告备置地点

基金管理人和基金托管人的住所

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)

中国上海市黄浦区湖滨路 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)

本期已实现收益

-1,468,483.6

本期利润

5,899,998.82

加权平均基金份额本期利润

0.037

本期加权平均净值利润率

3.75 %

本期基金份额净值增长率

3.42 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

期末可供分配利润

-901,692.31

期末可供分配基金份额利润

-0.0063

期末基金资产净值

146,476,760.02

期末基金份额净值

1.0157

报告期末

报告期末(2017-06-30)

基金份额累计净值增长率

1.57 %

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

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

4.27 %

0.57 %

3.41 %

0.41 %

0.86 %

0.16 %

过去三个月

1.17 %

0.56 %

3.59 %

0.39 %

-2.42 %

0.17 %

过去六个月

3.42 %

0.57 %

6.1 %

0.35 %

-2.68 %

0.22 %

过去一年

1.88 %

0.66 %

9.29 %

0.42 %

-7.41 %

0.24 %

自基金合同生效日起至今（2015 年 11 月 25 日-2017 年 06 月 30 日）

1.57 %

0.7 %

0.41 %

0.75 %

1.16 %

-0.05 %

注：注：①本基金业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深 300 指数} + 40\% \times \text{中债总财富总指数}$ ，

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：

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

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

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

注：根据《富安达健康人生灵活配置混合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 2016 年 5 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世纪大道 1568 号中建大厦，注册资本 2.88 亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司共管理 8 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

李守峰

本基金的基金经理

2015-12-25

-

7年

博士。历任万联证券研究所医药研究员。2013年3月加入富安达基金管理有限公司任行业研究员。

纪青

本基金的基金经理

2016-12-16

-

9年

硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。2013年4月加入富安达基金管理有限公司任高级金融工程研究员。

注：1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达健康人生混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

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

17年上半年A股整体震荡向上，上证综指上涨2.86%，深证成指涨3.46%，中小板指数上涨7.33%，创业板指数下跌7.34%。分行业看，价值类股票表现优于周期类股票，家电、食品饮料、非银、银行等行业涨幅居前，军工、农林牧渔、纺织服装等板块跌幅加大，健康相关的医药板块上半年涨幅0.1%，表现弱于大盘，位于所有行业中下游。我们主要仓位仍配置在医药行业上，整体看医药行业上半年没有趋势性行情，本基金表现略逊于基准。

报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本报告期富安达健康人生灵活配置混合份额净值为1.0157元，净值增长率为3.42%，同期业绩比较基准增长率为6.10%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度 GDP 同比增长 6.9%，宏观经济整体运行稳中向好，在消费有所抬升、出口有所改善、投资平稳及政策支持的情况下，我们预计下半年经济仍有较强的韧性，出现明显的下行是小概率事件。展望 17 年下半年，我们预期行情中性，指数窄幅震荡但仍有望延续上半年的结构性行情。17 年全年我们看好医药行业的表现，主要是因为我们认为医药行业在政策面上已经逐步接近底部了，一些利好因素可能会逐步推进，在一季度即出台了新版的医保目录，后续配套的招标政策也将逐步明确。另外，经过仿制药一致性评价的优势劣汰后，龙头企业的竞争环境将好于之前。在持仓结构上，我们将配置的重点放在了有核心竞争力且估值合理的大市值股票上，同时我们认为部分超跌成长股已经具备了一定性价比。

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

无

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年度上半年，基金托管人在富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2017 年度上半年，富安达基金管理有限公司在富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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 年度上半年，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

资产负债表

会计主体：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：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

9,343,497.73

50,917.01

结算备付金

1,169,706.42

20,666,239.68

存出保证金

92,124.25

150,944.56

交易性金融资产

116,475,944.07

117,475,588.43

其中：股票投资

116,475,944.07

117,475,588.43

基金投资

-

-

债券投资

-

-

资产支持证券投资

-

-

贵金属投资

-

-

衍生金融资产

-

-

买入返售金融资产

21,000,000

24,000,000

应收证券清算款

-

-

应收利息

7,278.87

22,454.3

应收股利

-

-

应收申购款

395.24

531.95

递延所得税资产

-

-

其他资产

41,954.77

-

资产总计

148,130,901.35

162,366,675.93

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

-

-

应付证券清算款

1,091,949.69

-

应付赎回款

20,912.63

-

应付管理人报酬

178,616.6

224,259.6

应付托管费

29,769.43

37,376.59

应付销售服务费

-

-

应付交易费用

218,799.63

623,319.3

应交税费

-

-

应付利息

-

-

应付利润

-

-

递延所得税负债

-

-

其他负债

114,093.35

90,000

负债合计

1,654,141.33

974,955.49

所有者权益：

-

-

实收基金

144,218,453.49

164,329,107.39

未分配利润

2,258,306.53

-2,937,386.95

所有者权益合计

146,476,760.02

161,391,720.44

负债和所有者权益总计

148,130,901.35

162,366,675.93

注：1.报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0157 元，基金份额总额 144,218,453.49 份。

利润表

会计主体：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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

8,262,620.68

2,584,697.24

1.利息收入

560,238.85

1,268,816.57

其中：存款利息收入

229,193.94

724,594.6

债券利息收入

43.84

30.25

资产支持证券利息收入

-

-

买入返售金融资产收入

331,001.07

544,191.72

其他利息收入

-

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

184,207.85

-11,520,951.56

其中：股票投资收益

-620,251.71

-12,338,317.66

基金投资收益

-

-

债券投资收益

8,956.16

-

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

795,503.4

817,366.1

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）

7,368,482.42

12,683,589.99

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）

-

-

5.其他收入（损失以“-”号填列）

149,691.56

153,242.24

减：二、费用

2,362,621.86

4,027,720.88

1. 管理人报酬

1,172,054.99

2,119,573.78

2. 托管费

195,342.46

353,262.3

3. 销售服务费

-

-

4. 交易费用

834,510.65

1,474,018.91

5. 利息支出

-

-

其中：卖出回购金融资产支出

-

-

6. 其他费用

160,713.76

80,865.89

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

5,899,998.82

-1,443,023.64

减：所得税费用

-

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

5,899,998.82

-1,443,023.64

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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）

164,329,107.39

-2,937,386.95

161,391,720.44

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

5,899,998.82

5,899,998.82

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）

-20,110,653.9

-704,305.34

-20,814,959.24

其中：1.基金申购款

29,436,737.54

-616,262.13

28,820,475.41

2.基金赎回款

-49,547,391.44

-88,043.21

-49,635,434.65

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）

144,218,453.49

2,258,306.53

146,476,760.02

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）

319,676,389.81

24,812.58

319,701,202.39

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

-1,443,023.64

-1,443,023.64

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）

-50,202,280.91

607,453.27

-49,594,827.64

其中：1.基金申购款

3,508,196.09

-98,460.48

3,409,735.61

2.基金赎回款

-53,710,477

705,913.75

-53,004,563.25

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）

164,329,107.39

-2,937,386.95

161,391,720.44

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

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]2041号《关于准予富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由富安达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币359,240,820.11元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1324号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年11月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为359,287,506.07份基金份额,其中认购资金利息折合46,685.96份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、资产支持证券、中小企业私募债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%,其中投资于健康人生主题相关的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。

会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 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

本基金所采用的会计政策与上年度会计报表相一致。

会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：**(1)**收取该金融资产现金流量的合同权利终止；**(2)**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；或者**(3)**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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金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。

损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：**(1)**该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；**(2)**本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；**(3)**本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，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[2008]38号《关于进一步规范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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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

9,343,497.73

-

定期存款

-

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

-

其他存款

-

-

合计

9,343,497.73

50,917.01

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

109,315,183.87

116,475,944.07

7,160,760.2

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

109,315,183.87

116,475,944.07

7,160,760.2

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

交易所市场

21,000,000

0

合计

21,000,000

0

项目

上年度末

2016-12-31

账面余额

其中：买断式逆回购

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持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

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

90.01

-

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

5,018.76

-

应收债券利息

-

-

应收买入返售证券利息

2,132.75

-

应收申购款利息

-

-

应收黄金合约拆借孳息

-

-

其他

37.3499999999995

-

合计

7,278.87

22,454.3

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

41,954.77

-

合计

41,954.77

-

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

218,798.13

-

银行间市场应付交易费用

1.5

-

合计

218,799.63

623,319.3

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

39.82

-

预提费用

114,053.53

-

合计

114,093.35

90,000

实收基金

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

基金份额（份）

账面金额

上年度末

164,329,107.39

164,329,107.39

本期申购

29,436,737.54

29,436,737.54

本期赎回（以“-”号填列）

-49,547,391.44

-49,547,391.44

本期末

144,218,453.49

144,218,453.49

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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

874,597.69

-3,811,984.64

-2,937,386.95

本期利润

-1,468,483.6

7,368,482.42

5,899,998.82

本期基金份额交易产生的变动数

-307,806.4

-396,498.94

-704,305.34

其中：基金申购款

-220,761.29

-395,500.84

-616,262.13

基金赎回款

-87,045.11

-998.1

-88,043.21

本期已分配利润

-

-

-

本期末

-901,692.31

3,159,998.84

2,258,306.53

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

2,348.33

-

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

226,009.89

-

其他

835.72

-

合计

229,193.94

724,594.6

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

293,295,294.29

-

减：卖出股票成本总额

293,915,546

-

买卖股票差价收入

-620,251.71

-

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

8,956.16

-

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

8,956.16

-

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

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

509,000.00

-

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

500,000.00

-

减：应收利息总额

43.84

-

买卖债券差价收入

8,956.16

-

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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可比期间无衍生工具收益。

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

795,503.4

-

基金投资产生的股利收益

-

-

合计

795,503.4

817,366.1

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

7,368,482.42

-

——股票投资

7,368,482.42

-

——债券投资

-

-

——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

7,368,482.42

12,683,589.99

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

134,530.95

-

基金转换费收入

15,160.61

-

合计

149,691.56

153,242.24

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费不低于其总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎

回费的 25%归入转出基金的基金资产。

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

834,510.65

-

银行间市场交易费用

-

-

合计

834,510.65

1,474,018.91

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

112,345.98

-

帐户维护费

18,000

-

汇划手续费

615

-

合计

160,713.76

80,865.89

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的日后事项。

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

-

-%

62,008,722.55

6.03 %

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：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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

-

-%

-

-%

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

57,748.65

6.03 %

28,632.60

8.04 %

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

1,172,054.99

2,119,573.78

其中：支付销售机构的客户维护费

546,026.01

1,060,734.28

注：支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值*1.50% / 当年天数。

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

195,342.46

353,262.3

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 * 0.25% / 当年天数。

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

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

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发生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固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

基金合同生效日（2015-11-25）持有的基金份额

-

-

报告期初持有的基金份额

9,999,000

-

报告期间申购/买入总份额

-

-

报告期间因拆分变动份额

-

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

-

报告期末持有的基金份额

9,999,000

9,999,000

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例

6.93 %

3.71 %

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

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

南京证券股份有限公司

4,999,000

3.47 %

4,999,000

3.04 %

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

9,343,497.73

2,348.33

17,297,343.45

239,724.78

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。于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的证券。

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

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无利润分配。

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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

600277

亿利洁能

2017-03-06

重大事项

7.17

-

-

400,000.00

2,690,400.00

2,868,000.00

-

300298

三诺生物

2017-05-17

重大资产重组

16.27

2017-07-17

16.09

171,387.00

2,773,743.55

2,788,466.49

-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购。

金融工具风险及管理

-

风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型证券投资基金，一般情况，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金通过资产的灵活配置，重点投资于能够满足人们对优质健康生活需求的上市公司，在有效控制风险的前提下，力争为投资者带来长期稳定的超额收益。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险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，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

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

-

-

合计

-

-

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

-

-

AAA 以下

-

-

未评级

-

-

合计

-

-

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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，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。

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。

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

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1 个月以内

1-3 个月

3 个月-1 年

1-5 年

5 年以上

不计息

合计

资产

银行存款

9,343,497.73

0

0

0

0

0

9,343,497.73

结算备付金

1,169,706.42

0

0

0

0

0

1,169,706.42

存出保证金

92,124.25

0

0

0

0

0

92,124.25

交易性金融资产

0

0

0

0

0

116,475,944.07

116,475,944.07

买入返售金融资产

21,000,000

0

0

0

0

0

21,000,000

应收利息

0

0

0

0

0

7,278.87

7,278.87

应收申购款

0

0

0

0

0

395.24

395.24

其他资产

0

0

0

0

0

41,954.77

41,954.77

资产总计

31,605,328.4

-

-

-

-

116,525,572.95

148,130,901.35

负债

应付证券清算款

0

0

0

0

0

1,091,949.69

1,091,949.69

应付赎回款

0

0

0

0

0

20,912.63

20,912.63

应付管理人报酬

0

0

0

0

0

178,616.6

178,616.6

应付托管费

0

0

0

0

0

29,769.43

29,769.43

应付交易费用

0

0

0

0

0

218,799.63

218,799.63

其他负债

0

0

0

0

0

114,093.35

114,093.35

负债总计

-

-

-

-

-

1,654,141.33

1,654,141.33

利率敏感度缺口

31,605,328.4

-

-

-

-

114,871,431.62

146,476,760.02

上年度末

2016-12-31

1 个月以内

1-3 个月

3个月-1年

1-5年

5年以上

不计息

合计

资产

银行存款

50,917.01

0

0

0

0

0

50,917.01

结算备付金

20,666,239.68

0

0

0

0

0

20,666,239.68

存出保证金

150,944.56

0

0

0

0

0

150,944.56

交易性金融资产

0

0

0

0

0

117,475,588.43

117,475,588.43

买入返售金融资产

24,000,000

0

0

0

0

0

24,000,000

应收利息

0

0

0

0

0

22,454.3

22,454.3

应收申购款

0

0

0

0

0

531.95

531.95

资产总计

44,868,101.25

-

-

-

-

117,498,574.68

162,366,675.93

负债

应付管理人报酬

0

0

0

0

0

224,259.6

224,259.6

应付托管费

0

0

0

0

0

37,376.59

37,376.59

应付交易费用

0

0

0

0

0

623,319.3

623,319.3

其他负债

0

0

0

0

0

90,000

90,000

负债总计

-

-

-

-

-

974,955.49

974,955.49

利率敏感度缺口

44,868,101.25

-

-

-

-

116,523,619.19

161,391,720.44

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

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

利率下降 25 个基点

-

-

利率上升 25 个基点

-

-

注：截至报告期末，本基金未持有交易性债券投资(2016年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016年12月31日：同)。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合 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，当证券市场系统性风险加大时，本基金的基金管理人将对相关证券资产的配置比例做出适时调整，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资比例范围为：股票投资占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于健康人生主题相关的上市公司的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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

116,475,944.07

79.52

117,475,588.43

72.79

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

116,475,944.07

79.52

117,475,588.43

72.79

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%

8,747,925.78

6,596,841.67

-5%

-8,747,925.78

-6,596,841.67

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

116,475,944.07

78.63

其中：股票

116,475,944.07

78.63

2

固定收益投资

-

-

其中：债券

-

-

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

21,000,000

14.18

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

10,513,204.15

7.1

7

其他各项资产

141,753.13

0.1

8

合计

148,130,901.35

100

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

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

-

-

B

采矿业

-

-

C

制造业

75,538,692.07

51.57

D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

4,345,000

2.97

E

建筑业

-

-

F

批发和零售业

12,449,052

8.5

G

交通运输、仓储和邮政业

2,536,000

1.73

H

住宿和餐饮业

-

-

I

信息传输、软件和信息技术服务业

4,589,000

3.13

J

金融业

9,854,900

6.73

K

房地产业

7,163,300

4.89

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

116,475,944.07

79.52

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

000661

长春高新

70,000

9,037,700

6.17

2

600887

伊利股份

350,000

7,556,500

5.16

3

600511

国药股份

200,000

7,248,000

4.95

4

600079

人福医药

330,000

6,474,600

4.42

5

000538

云南白药

57,000

5,349,450

3.65

6

600062

华润双鹤

190,000

5,211,700

3.56

7

000028

国药一致

60,000

4,854,000

3.31

8

600572

康恩贝

700,156

4,845,079.52

3.31

9

600285

羚锐制药

430,000

4,828,900

3.3

10

002223

鱼跃医疗

200,000

4,736,000

3.23

11

600406

国电南瑞

260,000

4,589,000

3.13

12

601901

方正证券

450,000

4,468,500

3.05

13

600176

中国巨石

400,000

4,392,000

3

14

600886

国投电力

550,000

4,345,000

2.97

15

001979

招商蛇口

200,000

4,272,000

2.92

16

600085

同仁堂

109,300

3,821,128

2.61

17

601288

农业银行

950,000

3,344,000

2.28

18

600420

现代制药

200,000

3,138,000

2.14

19

600048

保利地产

290,000

2,891,300

1.97

20

600277

亿利洁能

400,000

2,868,000

1.96

21

300298

三诺生物

171,387

2,788,466.49

1.9

22

600018

上港集团

400,000

2,536,000

1.73

23

300003

乐普医疗

110,000

2,432,100

1.66

24

002242

九阳股份

112,500

2,212,875

1.51

25

600030

中信证券

120,000

2,042,400

1.39

26

002614

奥佳华

80,000

1,454,400

0.99

27

600315

上海家化

40,000

1,298,000

0.89

28

600332

白云山

40,000

1,161,600

0.79

29

600867

通化东宝

55,440

1,011,225.6

0.69

30

000063

中兴通讯

37,304

885,596.96

0.6

31

600153

建发股份

20,000

258,600

0.18

32

002758

华通医药

6,300

88,452

0.06

33

603380

易德龙

1,298

35,370.5

0.02

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

600594

益佰制药

8,814,668.55

5.46

2

000661

长春高新

8,727,796.88

5.41

3

600085

同仁堂

7,246,744.82

4.49

4

600572

康恩贝

6,956,883.56

4.31

5

600511

国药股份

6,936,955

4.3

6

600420

现代制药

6,902,804.93

4.28

7

000538

云南白药

6,685,749.08

4.14

8

600887

伊利股份

6,547,157

4.06

9

600557

康缘药业

5,775,363

3.58

10

601111

中国国航

5,762,361

3.57

11

600436

片仔癀

5,190,253.64

3.22

12

601901

方正证券

5,104,588.04

3.16

13

601318

中国平安

5,072,880.83

3.14

14

600285

羚锐制药

4,910,711

3.04

15

600406

国电南瑞

4,642,200

2.88

16

600062

华润双鹤

4,501,718

2.79

17

002223

鱼跃医疗

4,360,704

2.7

18

300347

泰格医药

4,334,511.12

2.69

19

600030

中信证券

4,330,500

2.68

20

600176

中国巨石

4,245,507.32

2.63

21

000705

浙江震元

4,202,187

2.6

22

600886

国投电力

4,141,000

2.57

23

002758

华通医药

4,076,640.02

2.53

24

001979

招商蛇口

4,006,800

2.48

25

600332

白云山

3,993,428

2.47

26

600161

天坛生物

3,971,929.24

2.46

27

600267

海正药业

3,946,115

2.45

28

600718

东软集团

3,892,774

2.41

29

601288

农业银行

3,293,000

2.04

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

300123

太阳鸟

13,363,105.95

8.28

2

002589

瑞康医药

12,949,952.74

8.02

3

002462

嘉事堂

9,218,681.02

5.71

4

600594

益佰制药

8,444,306

5.23

5

002004

华邦健康

8,160,222.67

5.06

6

002094

青岛金王

7,539,807

4.67

7

600867

通化东宝

7,119,288.48

4.41

8

002626

金达威

6,789,840.95

4.21

9

300091

金通灵

6,747,000

4.18

10

601111

中国国航

6,271,233

3.89

11

600436

片仔癀

5,912,856

3.66

12

300273

和佳股份

5,835,334

3.62

13

600557

康缘药业

5,661,613

3.51

14

000590

启迪古汉

5,654,969.22

3.5

15

601318

中国平安

5,599,341.95

3.47

16

300097

智云股份

4,920,025

3.05

17

600161

天坛生物

4,104,906

2.54

18

600267

海正药业

3,917,320

2.43

19

600749

西藏旅游

3,833,181.02

2.38

20

600085

同仁堂

3,814,310

2.36

21

300347

泰格医药

3,787,513.34

2.35

22

600587

新华医疗

3,760,871.16

2.33

23

600420

现代制药

3,696,213.52

2.29

24

600718

东软集团

3,637,505.21

2.25

25

000705

浙江震元

3,601,697.85

2.23

26

002758

华通医药

3,466,065.08

2.15

27

002262

恩华药业

3,248,304.6

2.01

28

600332

白云山

3,222,943

2

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

285,547,419.22

卖出股票收入（成交）总额

293,295,294.29

期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注： 本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选库。

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

92,124.25

2

应收证券清算款

-

3

应收股利

-

4

应收利息

7,278.87

5

应收申购款

395.24

6

其他应收款

-

7

待摊费用

41,954.77

8

其他

-

9

合计

141,753.13

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

1,005

143,500.95

17,976,410.58

12.46 %

126,242,042.91

87.54 %

期末上市基金前十名持有人

序号

持有人名称

持有份额（份）

占上市总份额比例

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

19.76

0.0000137 %

期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目

持有基金份额总量的数量区间（万份）

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金

0

本基金基金经理持有本开放式基金

0

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

数值

基金合同生效日（2015-11-25）的基金份额总额

359,287,506.07

本报告期期初基金份额总额

164,329,107.39

本报告期期间基金总申购份额

29,436,737.54

减：本报告期期间基金总赎回份额

49,547,391.44

本报告期间基金拆分变动份额

-

本报告期末基金份额总额

144,218,453.49

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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

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。

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

长江证券

2

184,728,762.6

31.95 %

-

-%

509,000

100 %

305,000,000

31.28 %

0

0 %

135,091.69

27.57 %

-

东方证券

1

43,410,864.69

7.51 %

-

-%

0

0 %

0

0 %

0

0 %

40,428.29

8.25 %

-

国海证券

2

2,751,386.4

0.48 %

-

-%

0

0 %

12,000,000

1.23 %

0

0 %

2,012.02

0.41 %

-

海通证券

1

46,470,996.75

8.04 %

-

-%

0

0 %

217,000,000

22.26 %

0

0 %

43,278.15

8.83 %

-

华创证券

1

49,111,395.75

8.49 %

-

-%

0

0 %

0

0 %

0

0 %

45,737.28

9.34 %

-

申万宏源

1

101,042,394.28

17.48 %

-

-%

0

0 %

0

0 %

0

0 %

94,100.73

19.21 %

-

银河证券

1

95,354,946.89

16.49 %

-

-%

0

0 %

251,000,000

25.74 %

0

0 %

88,803.44

18.13 %

-

中投证券

1

55,336,489.74

9.57 %

-

-%

0

0 %

190,000,000

19.49 %

0

0 %

40,467.25

8.26 %

-

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）券商席位由投资管理部与研究发展部业务人员推荐，经投资管理部、研究发展部部门会议讨论，形成重点评估的券商备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

（二）投资管理部、研究发展部全体业务人员遵照券商选择标准的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成券商排名及专用席位租用意见，报公司总经理批准。

（三）公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议，明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

（四）若签约券商的服务不能满足要求，或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚，公司可以提前终止签署的协议，并撤销租用的席位。

③在租用的券商交易单元中，（003133）华金证券、（38262）华金证券、

（003441）信达证券、（48045）中泰证券、（390511）中泰证券为本基金本期新增的交易单元。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

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇一六年第二号）

公司网站

2017-01-06

3

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇一六年第二号）摘要

指定报刊和公司网站

2017-01-06

4

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

指定报刊和公司网站

2017-01-20

5

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

6

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

7

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

公司网站

2017-03-27

8

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

指定报刊和公司网站

2017-03-27

9

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

10

富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

指定报刊和公司网站

2017-04-21

11

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

12

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

13

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

-

-

-

-

-

-

-

个人

-

-

-

-

-

-

-

产品特有风险

-

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

影响投资者决策的其他重要信息

无

备查文件目录

1.中国证监会批准富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金设立的文件：

《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

《富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

2.《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

- 3.基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4.基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 5.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6.中国证监会要求的其他文件。

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）查阅。