

# 富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金

## 2018 年半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

2018年05月19日起，富安达长盈保本混合型证券投资基金转型为富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金。

本报告期自2018年01月01日至2018年06月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 转型后

基金简称	富安达长盈混合
基金主代码	002584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年05月19日
基金管理人	-
基金托管人	-
报告期末基金份额总额	14,613,656.99份
基金合同存续期	不定期

#### 转型前

基金简称	富安达长盈保本混合
场内简称	-
基金主代码	002584
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年05月11日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,360,433.51份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

#### 转型后

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、

	物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型，辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

### 转型前

投资目标	通过运用投资组合保险技术，有效控制本金损失的风险，在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金运用 CPPI 恒定比例组合保险策略，动态调整安全资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保保本周期到期时，基金资产在保本基础上实现保值增值的目的。
业绩比较基准	二年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

### 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	-	-
信息披露负责人	姓名	沈伟青
	联系电话	021-61870999
	电子邮箱	service@fadfunds.com
客户服务电话	400-630-6999（免长途）021	95528

	-61870666	
传真	021-61870888	021-63602540

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现(转型后)

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年05月19日（转型后首日）- 2018年06月30日）
本期已实现收益	-135,775.87
本期利润	-191,834.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0121
本期基金份额净值增长率	-1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.0098
期末基金资产净值	14,409,710.33
期末基金份额净值	0.986

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，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本基金于2018年5月19日成立。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-1.50%	0.25%	-4.24%	0.76%	2.74%	-0.51%
自基金合同 生效起至今	-1.40%	0.21%	-5.52%	0.73%	4.12%	-0.52%

①本基金业绩比较基准为：60%×沪深300指数+40%×中债总指数，

②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

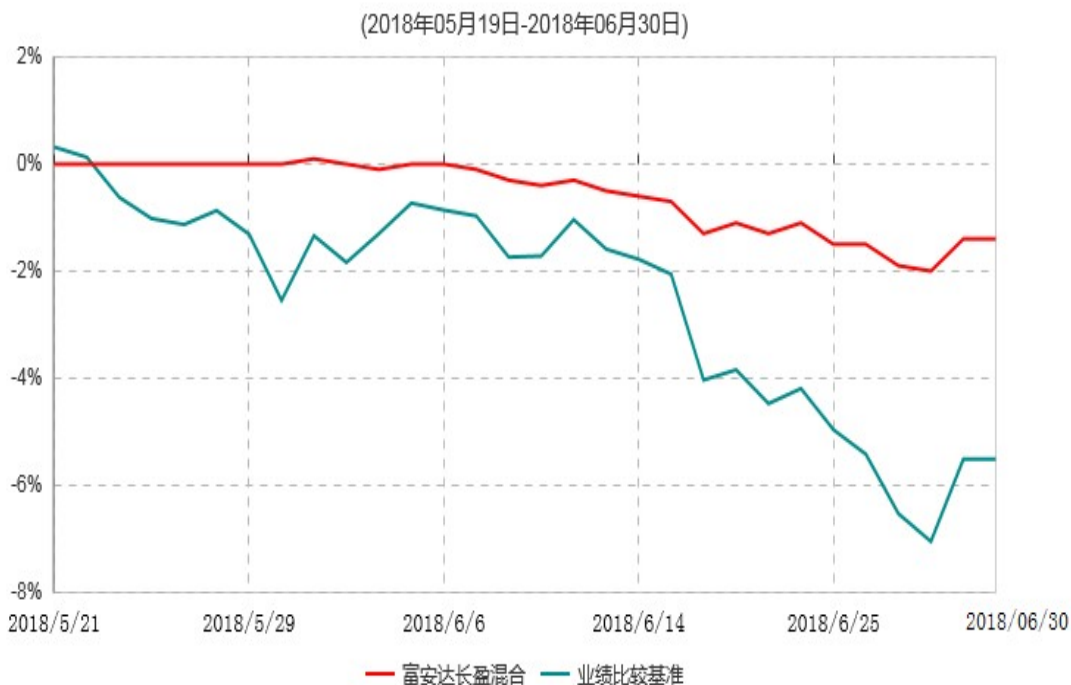
$$\text{Return } t = 60\% \times [\text{沪深300指数}_t / \text{沪深300指数}_{(t-1)} - 1] + 40\% \times [\text{中债总指数}_t / \text{中债总指数}_{(t-1)} - 1]$$

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

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

### 3.2.2 自基金转型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

富安达长盈灵活配置混合型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



1、本基金由富安达长盈保本混合型证券投资基金转型而来并于2018年5月19日合同生效，上图报告期间的起始日为2018年5月19日，截止本报告期末本基金转型合同生效未满一年。

2、本基金建仓期为自基金转型日起的六个月。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现（转型前）

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年01月01日- 2018年05月18日）
本期已实现收益	2,062,471.98
本期利润	1,890,999.39
加权平均基金份额本期利润	0.0134
本期基金份额净值增长率	-0.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年05月18日）
期末可供分配基金份额利润	0.0099
期末基金资产净值	21,360,433.51
期末基金份额净值	1.0000

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，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本基金于2016年5月11日成立。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-	-	-	-	0.00%	0.00%
过去三个月	-3.57%	0.49%	0.28%	0.01%	-3.85%	0.48%
过去六个月	-0.81%	0.22%	0.79%	0.01%	-1.60%	0.21%
过去一年	1.86%	0.16%	1.85%	0.01%	0.01%	0.15%

自基金合同生效起至今	1.96%	0.14%	4.24%	0.01%	-2.28%	0.13%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

注：①本基金业绩比较基准为：二年期银行定期存款收益率

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：

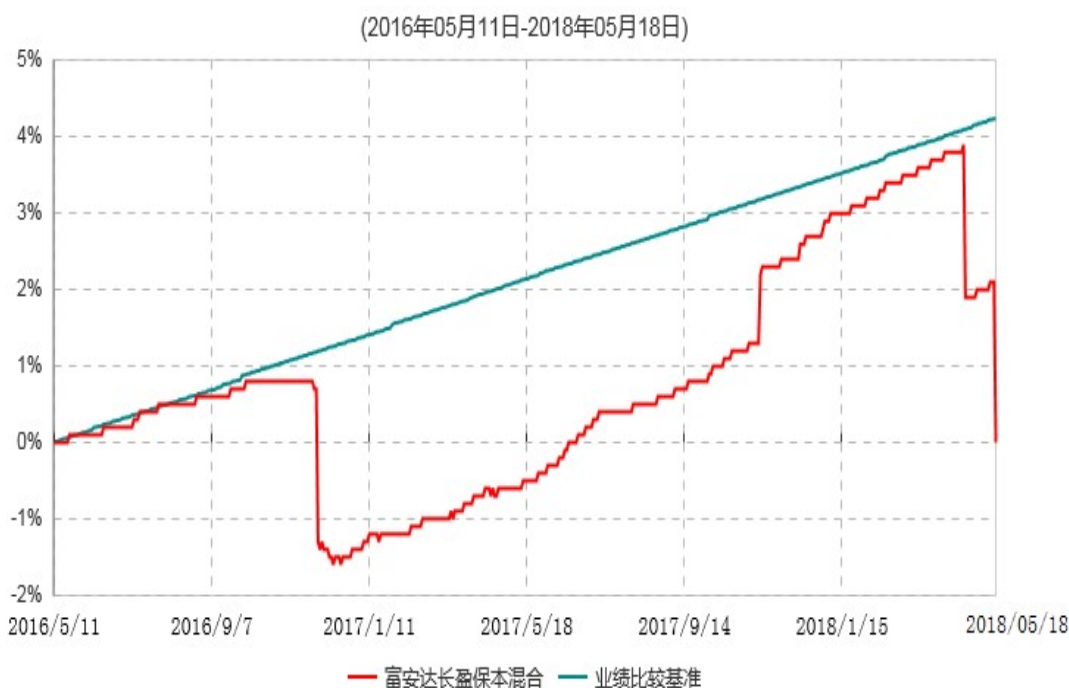
$$\text{Return } t = \text{今日指数}t / \text{昨日指数}(t-1) - 1$$

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

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

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

富安达长盈保本混合型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



本基金于2016年5月11日成立，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2016年11月10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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验



富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2018年6月30日，公司共管理十只开放式基金：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、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李飞	本基金的基金经理、投资管理部总监助理（主持工作）、公司固定收益部副总监（主持工作）	2016-05-11	2018-05-21	14年	博士。历任上海应用技术学院财政经济系教师；聚源数据有限责任公司研究发展中心项目经理；国盛证券有限责任公司投资研究部高级宏观债券研究员；金元惠理基金管理有限公司投资部基金经理。2012年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年7月起任富安达增强收益债券型证券投资基金的基金经理、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理（2013年10月25日至2016年10月25日期间），富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理（2016年5月11日至2018年5月21日期间）。

张凯瑜	本基金的基金经理	2016-07-22	2018-05-21	10年	硕士。历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理员；爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员。2011年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年1月起任富安达现金通货币市场证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理（2013年10月25日至2016年10月25日期间），富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理（2016年5月11日至2018年5月21日期间）。
朱义	本基金的基金经理	2018-04-13	-	15年	硕士。历任金元顺安基金管理有限公司风险管理专员；上投摩根基金管理有限公司高级风险管理经理；富安达基金管理有限公司监察稽核部副总监、研究发展部研究总监助理兼基金经理助理。2018年4月13日起任富安达长盈保本混合型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》、《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害

基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

受金融去杠杆和中美贸易战影响,今年二季度以来证券市场经历了快速下跌。本基金自5月从保本基金转型为灵活配置基金以来,放缓建仓节奏,以配置逆回购和利率债等固定收益类为主。未来随着贸易战阶段性缓和,本基金将从业绩增长和估值的匹配度出发,逐步配置受益于中国内需和产业结构升级的大消费、医药、先进制造、计算机信息化等景气度向上行业的优质龙头公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年5月18日,富安达长盈混合基金份额净值为1.0000元;自2018年1月1日至2018年5月18日本基金份额净值增长率为-0.81%,同期业绩比较基准收益率为0.79%。

截至2018年6月30日,富安达长盈混合基金份额净值为0.986元;自2018年5月19日至2018年6月30日本基金份额净值增长率为-1.40%,同期业绩比较基准收益率为-5.52%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年以来宏观经济形势非常复杂，虽然对经济数据的跟踪观察，中国经济仍保持了足够的韧性，但伴随着金融去杠杆和社会融资数据增速下滑，投资者对于未来经济预期偏悲观。与此同时，中美贸易战愈演愈烈，已经从短期贸易逆差变成了更长期中美经济贸易的博弈，其过程必将曲折而漫长。在中美贸易战的大背景下，后继国内有望加快改革开放，出台更多扩内需和发展新兴产业相关政策来对冲其影响。政策层面，我们预计财政政策更加积极，货币政策趋向稳杠杆。近期产业资本不断增持和回购，越来越多个股进入中长期投资价值区间。我们相对更看好受益于中国内需和产业结构升级的大消费、医药、先进制造、计算机信息化等景气度向上行业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期进行了一次收益分配，金额为2,696,905.75元。

#### 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

本报告期内，本基金自2018年5月15日起连续超出二十个工作日基金净值低于5000万。

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

## § 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对富安达长盈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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为2,696,905.75元。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告(未经审计)(转型后)

### 6.1 资产负债表

会计主体：富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日
<b>资产：</b>		
银行存款		6,354,442.02
结算备付金		83,113.36
存出保证金		3,764.57
交易性金融资产		3,042,070.17
其中：股票投资		1,990,087.77
基金投资		-
债券投资		1,051,982.40
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		2,000,000.00
应收证券清算款		3,063,757.31
应收利息		10,972.84
应收股利		-
应收申购款		18,957.08
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		14,577,077.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年06月30日</b>
<b>负 债:</b>		
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		24,042.07
应付赎回款		-
应付管理人报酬		17,855.06
应付托管费		2,975.84
应付销售服务费		-
应付交易费用		7,715.23
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		114,778.82
负债合计		167,367.02
<b>所有者权益:</b>		
实收基金		14,167,061.79

未分配利润		242,648.54
所有者权益合计		14,409,710.33
负债和所有者权益总计		14,577,077.35

1. 报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.986元，基金份额总额14,613,656.99份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2018年5月19日至2018年6月30日期间。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年05月19日（转型后首日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年05月19日（转型后首日）至2018年06月30日
<b>一、收入</b>		-118,145.26
1. 利息收入		51,788.93
其中：存款利息收入		16,532.96
债券利息收入		3,256.18
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		31,999.79
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-113,878.46
其中：股票投资收益		-122,979.25
基金投资收益		-
债券投资收益		-
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		9,100.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-56,058.87

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		3.14
<b>减：二、费用</b>		73,689.48
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	27,069.17
2. 托管费	6.4.8.2.2	4,511.54
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-
4. 交易费用		9,616.94
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用		32,491.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-191,834.74
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-191,834.74

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年05月19日（转型后首日）至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年05月19日（转型后首日）至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	20,913,838.31	446,595.20	21,360,433.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-191,834.74	-191,834.74
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）	-6,746,776.52	-12,111.92	-6,758,888.44



其中：1. 基金申购款	1,652,271.46	-25,625.62	1,626,645.84
2. 基金赎回款	-8,399,047.98	13,513.70	-8,385,534.28
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）	14,167,061.79	242,648.54	14,409,710.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

蒋晓刚

沈伟青

顾颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富安达长盈保本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[2016]566号《关于准予富安达长盈保本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《富安达长盈保本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376,258,200.64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(2016)第570号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年5月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为376,386,143.24份基金份额,其中认购资金利息折合127,942.60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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达长盈保本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、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金

投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票等风险资产的比例不高于基金资产净值的40%，安全资产的比例不低于基金资产净值的60%，现金或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%。本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2018年8月29日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、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》、《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018半年度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2018年6月30日的财务状况以及2018上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税

[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，关联方关系未发生变化。

##### 6.4.7.2 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年05月19日（转型后首日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	27,069.17
其中：支付销售机构的客户维护费	3,141.41

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售

机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年05月19日（转型后首日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,511.54

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2018年05月19日（转型后首日）至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	6,354,442.02	16,428.67

本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，活期存款按银行同业利率计息，定期存款按约定利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起

运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

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

除增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 6 年度财务会计报告(未经审计)(转型前)

### 6.1 资产负债表

会计主体：富安达长盈保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年05月18日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年05月18日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		320,330.27	1,026,077.09
结算备付金		-	-
存出保证金		3,869.06	495.18
交易性金融资产		-	164,606,213.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	164,606,213.60
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		52,845,439.27	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		71,877.83	3,300,428.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	9.88
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-

资产总计		53,241,516.43	168,933,224.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> 2018年05月18日	<b>上年度末</b> 2017年12月31日
<b>负 债:</b>			
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		-	-
应付赎回款		7,734,088.92	410,053.36
应付管理人报酬		53,225.63	174,897.66
应付托管费		8,870.94	29,149.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,158.26	4,124.64
应交税费		529.51	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		24,083,209.66	222,323.42
负债合计		31,881,082.92	840,548.68
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		20,913,838.31	163,590,342.10
未分配利润		446,595.20	4,502,333.64
所有者权益合计		21,360,433.51	168,092,675.74
负债和所有者权益总计		53,241,516.43	168,933,224.42

1. 报告截止日2018年5月18日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额21,360,433.51份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年5月18日期间。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达长盈保本混合型证券投资基金



本报告期：2018年01月01日至2018年05月18日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年05月18日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
<b>一、收入</b>		2,773,768.67	5,225,452.14
1. 利息收入		2,456,024.22	5,175,487.27
其中：存款利息收入		917,612.05	1,481,049.81
债券利息收入		1,408,327.55	3,522,666.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		130,084.62	171,770.58
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		426,614.77	-274,117.35
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		426,614.77	-274,117.35
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		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-171,472.59	205,586.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		62,602.27	118,495.26
<b>减：二、费用</b>		882,769.28	1,922,965.01
1. 管理人报酬	6.4.8.2	654,838.92	1,349,809.26

	. 1		
2. 托管费	6. 4. 8. 2 . 2	109, 139. 82	224, 968. 19
3. 销售服务费	6. 4. 8. 2 . 3	-	-
4. 交易费用		1, 663. 10	1, 419. 63
5. 利息支出		8, 086. 99	212, 926. 68
其中：卖出回购金融资产支出		8, 086. 99	212, 926. 68
6. 税金及附加		1, 044. 30	-
7. 其他费用		107, 996. 15	133, 841. 25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 890, 999. 39	3, 302, 487. 13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 890, 999. 39	3, 302, 487. 13

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达长盈保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年05月18日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年05月18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)	163, 590, 342. 1 0	4, 502, 333. 64	168, 092, 675. 74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1, 890, 999. 39	1, 890, 999. 39
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）	-142, 676, 503. 79	-3, 249, 832. 08	-145, 926, 335. 87
其中：1. 基金申购款	117, 251. 13	3, 705. 27	120, 956. 40

2. 基金赎回款	-142,793,754.92	-3,253,537.35	-146,047,292.27
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）	-	-2,696,905.75	-2,696,905.75
五、期末所有者权益（基金净值）	20,913,838.31	446,595.20	21,360,433.51
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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）	246,570,804.49	-3,392,084.33	243,178,720.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,302,487.13	3,302,487.13
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）	-39,416,501.16	301,045.94	-39,115,455.22
其中：1. 基金申购款	34,880.39	-329.92	34,550.47
2. 基金赎回款	-39,451,381.55	301,375.86	-39,150,005.69
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）	207,154,303.33	211,448.74	207,365,752.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富安达长盈保本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[2016]566号《关于准予富安达长盈保本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《富安达长盈保本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376,258,200.64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(2016)第570号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年5月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为376,386,143.24份基金份额,其中认购资金利息折合127,942.60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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达长盈保本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、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票等风险资产的比例不高于基金资产净值的40%,安全资产的比例不低于基金资产净值的60%,现金或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%。本基金的业绩比较基准:二年期银行定期存款收益率(税后)。

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2018年8月29日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、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》、《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018半年度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2018年5月18日的财务状况以及2018上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至

1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，关联方关系未发生变化。

##### 6.4.7.2 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司（“南京证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司（“江苏交通”）	基金管理人的股东
南京市河西新城国有资产经营控股（集团）有限责任公司（“南京河西”）	基金管理人的股东
富安达资产管理（上海）有限公司（“富安达资管”）	基金管理人的全资子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 6.4.8.1.4 债券回购交易

#### 6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至201 8年05月18日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	654,838.92	1,349,809.26
其中：支付销售机构的客户维护费	57,635.95	127,051.57

1. 支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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×1.20% / 当年天数。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年05月18日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	109,139.82	224,968.19

支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20% / 当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

**6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期内无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年0 5月18日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年0 6月30日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
上海浦东发展银行股份有 限公司	320,330.27	28,113.65	1,018,707. 01	13,053.40

本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，活期存款按银行同业利率计息，定期存款按约定利率计息。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**6.4.9 期末（2018年05月18日）本基金持有的流通受限证券****6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**



#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金2018年5月18日的财务状况和2018年上半度的经营成果无影响。

除增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告(转型后)

#### 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	1,990,087.77	13.65
	其中：股票	1,990,087.77	13.65
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,051,982.40	7.22
	其中：债券	1,051,982.40	7.22
	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	2,000,000.00	13.72
	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	6,437,555.38	44.16
8	其他各项资产	3,097,451.80	21.25
9	合计	14,577,077.35	100.00

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。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	982,706.43	6.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	65,953.48	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	432,309.06	3.00
J	金融业	307,796.00	2.14
K	房地产业	118,632.80	0.82
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	33,900.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	48,790.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	1,990,087.77	13.81

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600519	贵州茅台	300	219,438.00	1.52
2	600867	通化东宝	6,100	146,217.00	1.01
3	300170	汉得信息	8,117	131,820.08	0.91
4	601288	农业银行	36,300	124,872.00	0.87
5	600048	保利地产	9,724	118,632.80	0.82
6	601318	中国平安	2,000	117,160.00	0.81
7	002456	欧菲科技	5,600	90,328.00	0.63
8	300253	卫宁健康	7,100	87,969.00	0.61
9	300166	东方国信	5,800	85,434.00	0.59
10	600884	杉杉股份	3,400	75,140.00	0.52

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600048	保利地产	429,267.00	2.98
2	601601	中国太保	236,249.00	1.64
3	600519	贵州茅台	234,295.00	1.63
4	002024	苏宁易购	232,245.00	1.61

5	300170	汉得信息	195,190.00	1.35
6	601318	中国平安	180,752.00	1.25
7	600867	通化东宝	148,827.00	1.03
8	601288	农业银行	132,767.00	0.92
9	600521	华海药业	129,838.00	0.90
10	600383	金地集团	120,403.00	0.84
11	002410	广联达	109,133.00	0.76
12	603156	养元饮品	108,038.00	0.75
13	002327	富安娜	107,696.00	0.75
14	002419	天虹股份	103,822.00	0.72
15	603839	安正时尚	102,245.00	0.71
16	002033	丽江旅游	101,993.00	0.71
17	002763	汇洁股份	100,633.00	0.70
18	002304	洋河股份	98,333.00	0.68
19	000681	视觉中国	95,045.00	0.66
20	002456	欧菲科技	93,086.00	0.65

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	291,540.81	2.02
2	601601	中国太保	238,345.60	1.65
3	002024	苏宁易购	205,522.10	1.43
4	600383	金地集团	118,973.50	0.83
5	603839	安正时尚	101,949.25	0.71
6	002327	富安娜	95,808.61	0.66
7	002763	汇洁股份	94,121.72	0.65
8	600612	老凤祥	91,860.00	0.64

9	002033	丽江旅游	89,533.72	0.62
10	600073	上海梅林	86,680.00	0.60
11	603156	养元饮品	82,718.00	0.57
12	600535	天士力	79,460.00	0.55
13	600233	圆通速递	76,644.77	0.53
14	600703	三安光电	72,205.83	0.50
15	300170	汉得信息	70,711.90	0.49
16	002410	广联达	56,806.87	0.39
17	600521	华海药业	56,163.60	0.39
18	002384	东山精密	55,133.02	0.38
19	600019	宝钢股份	53,466.00	0.37
20	601318	中国平安	47,168.00	0.33

1、“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,606,141.94
卖出股票收入（成交）总额	2,434,396.05

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,051,982.40	7.30
	其中：政策性金融债	1,051,982.40	7.30
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	1,051,982.40	7.30

#### 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	018005	国开1701	10,480	1,051,982.40	7.30

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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投资。

#### 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 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	3,764.57
2	应收证券清算款	3,063,757.31
3	应收股利	-
4	应收利息	10,972.84
5	应收申购款	18,957.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,097,451.80

**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可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

**§7 投资组合报告（转型前）****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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	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	52,845,439.27	99.26
	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	320,330.27	0.60
8	其他各项资产	75,746.89	0.14
9	合计	53,241,516.43	100.00

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。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票资产。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票资产。

## 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

本基金本报告期末未持有股票资产。

### 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

本基金本报告期末未持有股票资产。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票资产。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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投资。

#### 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 本基金本报告期末未持有股票资产。

#### 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	3,869.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	71,877.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,746.89

#### 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可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票资产。

#### 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(转型后)

#### 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
505	28,937.93	554,804.73	3.80%	14,058,852.26	96.20%

#### 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	25,545.13	0.17%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

### § 8 基金份额持有人信息(转型前)

## 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
612	34,902.67	554,804.73	2.60%	20,805,628.78	97.40%

## 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	25,545.13	0.12%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

## §9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日(2018年05月19日)基金份额总额	21,360,433.51
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	1,652,271.46
减：本报告期基金总赎回份额	8,399,047.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,613,656.99

## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日(2016年05月11日)基金份额总额	376,386,143.24
本报告期期初基金份额总额	163,590,342.10
本报告期基金总申购份额	563,846.33
减：本报告期基金总赎回份额	142,793,754.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,360,433.51

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动：

2018年5月19日，富安达基金管理有限公司发布《富安达基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，张丽珉女士因已届法定退休年龄离任公司督察长，公司聘任李理想先生为督察长。

上述变动中的高级管理人员变更事项已按规定报中国证监会上海监管局及中国基金业协会备案。

本报告期，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 转型后

报告期2018年05月19日（转型后首日） - 2018年06月30日

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	7,040,537.99	100.00%	6,556.97	100.00%	-

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本期无新增的交易单元。

### 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
招商证券	1,055,440.02	100.00%	55,500,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 转型前

报告期2018年01月01日 - 2018年05月18日

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	-	-	-	-	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

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

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

（三）能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他信息咨询服务；

（四）能根据公司特定要求，提供专门研究报告；

（五）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；能够提供很好的交易执行。

②券商专用交易单元选择程序：

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

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

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

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

③本期无新增的交易单元。

#### 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
招商证券	1,589,428.26	100.00%	-	-	-	-	-	-

#### § 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

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

##### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

富安达基金管理有限公司  
二〇一八年八月二十九日