

**富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金（原长盈保本混  
合型证券投资基金转型）**

**2018 年半年度报告**

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。

## 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	6
2.1 基金基本情况	6
转型后	6
转型前	6
2.2 基金产品说明	6
转型后	6
转型前	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§3 主要财务指标和基金净值表现（转型前）	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告(未经审计)(转型后)	16
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	21
§6 年度财务会计报告(未经审计)(转型前)	38
6.1 资产负债表	38
6.2 利润表	40
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	41
6.4 报表附注	43
§7 投资组合报告(转型后)	61
7.1 期末基金资产组合情况	61
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	63

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	67
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	67
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	67
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§7 投资组合报告（转型前）	68
7.1 期末基金资产组合情况	68
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	69
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	69
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69
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	69
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	70
§8 基金份额持有人信息(转型后)	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
§8 基金份额持有人信息(转型前)	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	72
§9 开放式基金份额变动(转型后)	72
§9 开放式基金份额变动(转型前)	72
§10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4 基金投资策略的改变	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	73
转型后	73
报告期 2018 年 05 月 19 日（转型后首日） - 2018 年 06 月 30 日	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
转型前	75
报告期 2018 年 01 月 01 日 - 2018 年 05 月 18 日	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
10.8 其他重大事件	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息	80
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	80

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
§12 备查文件目录.....	80
12.1 备查文件目录.....	80
12.2 存放地点.....	81
12.3 查阅方式.....	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 转型后

基金名称	富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金
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

基金名称	富安达长盈保本混合型证券投资基金
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

	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	胡波
	联系电话	021-61870999	021-61618888
	电子邮箱	service@fadfunds.com	hub5@spdb.com.cn

客户服务电话	400-630-6999（免长途）021-61870666	95528
传真	021-61870888	021-63602540
注册地址	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	上海市中山东一路12号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼	上海市北京东路689号
邮政编码	200122	200120
法定代表人	蒋晓刚	高国富

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
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

#### 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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

### § 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
本期加权平均净值利润率	-1.22%
本期基金份额净值增长率	-1.40%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2018年06月30日）
期末可供分配利润	142,771.71
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
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2018年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-1.40%

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：

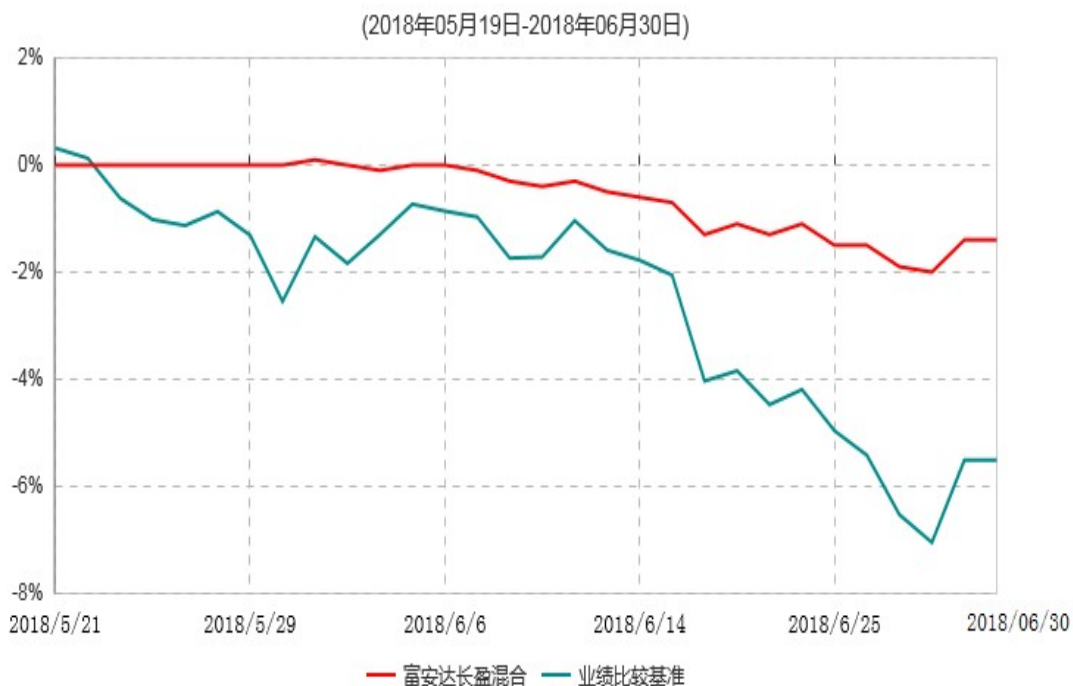
$$\text{Return } t = 60\% \times [\text{沪深300指数}_t / \text{沪深300指数}_{(t-1)} - 1] + 40\% \times [\text{中债总指数}_t / \text{中债总指数}_{(t-1)} - 1]$$

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

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足一年。
- 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
本期加权平均净值利润率	1.30%
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）

期末可供分配利润	210,911.45
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
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2018年05月18日）
基金份额累计净值增长率	-

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：

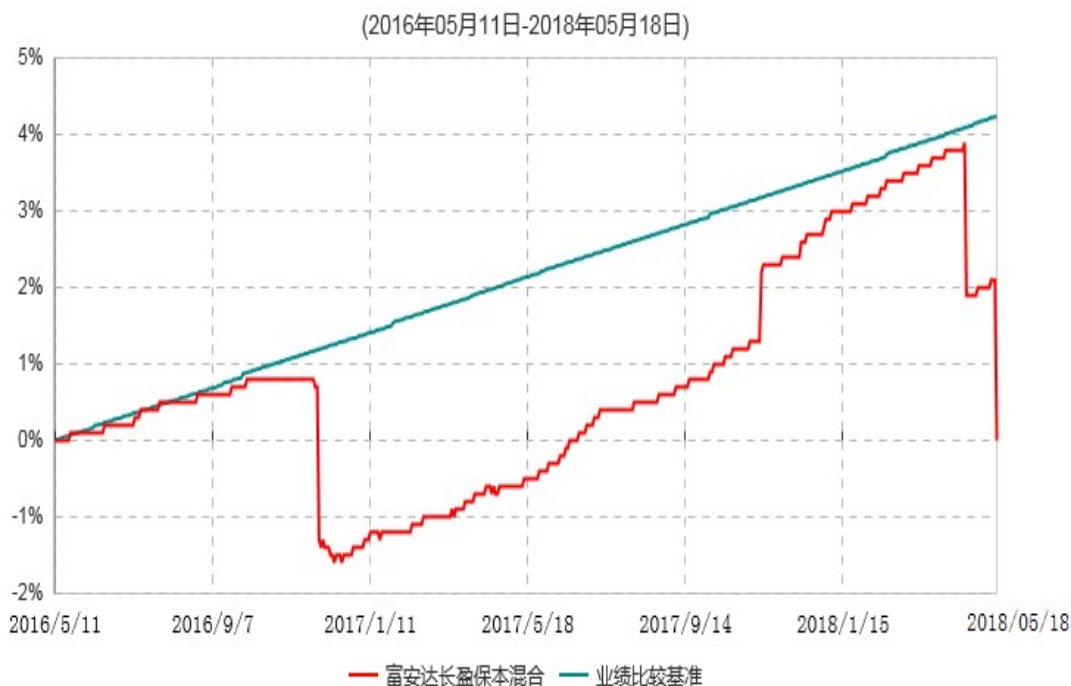
$$\text{Return } t = \text{今日指数}t / \text{昨日指数}(t-1) - 1$$

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

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）。

					1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合规守信情况的说明

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遵规守信、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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,000,000.00
应收证券清算款		3,063,757.31
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-
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	6.4.7.3	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	114,778.82
负债合计		167,367.02
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	14,167,061.79
未分配利润	6.4.7.10	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
一、收入		-118,145.26
1. 利息收入		51,788.93

其中：存款利息收入	6.4.7.11	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	6.4.7.12	-122,979.25
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	9,100.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-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）	6.4.7.19	3.14
<b>减：二、费用</b>		73,689.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	27,069.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,511.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	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	6.4.7.21	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 $\times$ 60%+中国债券总指数收益率 $\times$ 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 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 2018年06月30日
活期存款	6,354,442.02
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	6,354,442.02

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,048,766.64	1,990,087.77	-58,678.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,049,362.40	1,051,982.40
	银行间市场	-	-
	合计	1,049,362.40	1,051,982.40

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,098,129.04	3,042,070.17	-56,058.87

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-

##### 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从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 2018年06月30日
应收活期存款利息	2,417.63
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	33.66
应收债券利息	9,333.80
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-813.78
应收申购款利息	-



应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.53
合计	10,972.84

#### 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 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	6,556.97
银行间市场应付交易费用	1,158.26
合计	7,715.23

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	114,778.82
合计	114,778.82

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：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	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	21,360,433.51	20,913,838.31
基金份额折算调整	-	-

未领取红利份额折算调整(若有)	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	1,652,271.46	1,652,271.46
本期赎回(以“-”号填列)	-8,399,047.98	-8,399,047.98
本期末	14,613,656.99	14,167,061.79

## 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
基金合同生效日	210,911.45	235,683.75	446,595.20
本期利润	-135,775.87	-56,058.87	-191,834.74
本期基金份额交易产生的变动数	67,636.13	-79,748.05	-12,111.92
其中：基金申购款	-32,087.06	6,461.44	-25,625.62
基金赎回款	99,723.19	-86,209.49	13,513.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	142,771.71	99,876.83	242,648.54

## 6.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	16,428.67
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	97.25
其他	7.04
合计	16,532.96

**6.4.7.12 股票投资收益**

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
卖出股票成交总额	2,434,396.05
减：卖出股票成本总额	2,557,375.30
买卖股票差价收入	-122,979.25

**6.4.7.13 基金投资收益**

本基金本报告期内无基金投资收益。

**6.4.7.14 债券投资收益****6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 贵金属投资收益****6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

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
股票投资产生的股利收益	9,100.79

基金投资产生的股利收益	-
合计	9,100.79

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年05月19日（转型后首日） 至2018年06月30日
1. 交易性金融资产	-56,058.87
——股票投资	-58,678.87
——债券投资	2,620.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-56,058.87

## 6.4.7.19 其他收入

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
基金赎回费收入	3.14
合计	3.14

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持续持有期少于30日的投资人的赎回费全额计入基金资产，对持续持有期少于3个月的投资人，应将不低于赎回费总额75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人，应将不低于赎回费总额50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

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。

#### 6.4.7.20 交易费用

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
交易所市场交易费用	9,616.94
银行间市场交易费用	-
合计	9,616.94

#### 6.4.7.21 其他费用

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
审计费用	12,751.22
信息披露费	18,849.48
汇划手续费	891.13
合计	32,491.83

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，关联方关系未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司（“富安达基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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
南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司（“南京河西”）	基金管理人的股东
富安达资产管理（上海）有限公司（“富安达资管”）	基金管理人的全资子公司

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 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。

##### 6.4.10.2 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
	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。

#### 6.4.10.2.2 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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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

公司		
----	--	--

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期内及上年度可比期间无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018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

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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 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市场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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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

本基金为混合型证券投资基金，其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。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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行浦发银行，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2018年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2018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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自2017年10月1日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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该比例限制）。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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年 06月30 日	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	6,354,442.02	-	-	-	-	-	6,354,442.02
结算备付金	83,113.36	-	-	-	-	-	83,113.36
存出保证金	3,764.57	-	-	-	-	-	3,764.57
交易性金融资产	-	-	1,051,982.40	-	-	1,990,087.77	3,042,070.17
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	-	-	2,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,063,757.31	3,063,757.31
应收利息	-	-	-	-	-	10,972.84	10,972.84
应收申购款	-	-	-	-	-	18,957.08	18,957.08
资产总计	8,441,319.95	-	1,051,982.40	-	-	5,083,775.00	14,577,077.35
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	24,042.07	24,042.07
应付管理人报	-	-	-	-	-	17,855.06	17,855.06

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	2,975.84	2,975.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,715.23	7,715.23
其他负债	-	-	-	-	-	114,778.82	114,778.82
负债总计	-	-	-	-	-	167,367.02	167,367.02
利率敏感度缺口	8,441,319.95	-	1,051,982.40	-	-	4,916,407.98	14,409,710.33

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至报告期末，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7.30%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合联储模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资比例范围为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%；投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的3%，任何交易日日终在

扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	1,990,087.77	13.81
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,051,982.40	7.30
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	3,042,070.17	21.11

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金转型日期为2018年5月19日。本报告期末，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为13.81%(2017年12月31日：0%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日：同)。

#### 6.4.14 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	6.4.7.1	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	6.4.7.2	-	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	52,845,439.27	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	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	6.4.7.6	-	-
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 2018年05月18日</b>	<b>上年度末 2017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		-	-
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	6.4.7.7	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	6.4.7.8	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	6.4.7.9	20,913,838.31	163,590,342.10
未分配利润	6.4.7.1 0	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
一、收入		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	6.4.7.1 1	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	6.4.7.1 2	-	-
基金投资收益	6.4.7.1 3	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 4	426,614.77	-274,117.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 4.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 5	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1	-	-



	6		
股利收益	6.4.7.1 7	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.1 8	-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)	6.4.7.1 9	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	6.4.10. 2.1	654,838.92	1,349,809.26
2. 托管费	6.4.10. 2.2	109,139.82	224,968.19
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.2 0	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	6.4.7.2 1	107,996.15	133,841.25
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		1,890,999.39	3,302,487.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		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)	163,590,342.10	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 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 2018年05月18日
活期存款	320,330.27
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	320,330.27

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2018年05月18日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	52,845,439.27	-
合计	52,845,439.27	-

##### 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从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 2018年05月18日
应收活期存款利息	22,389.39
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	49,478.15
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.29
合计	71,877.83

#### 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 2018年05月18日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,158.26
合计	1,158.26

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年05月18日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	31.54
预提费用	83,178.12
其他应付	24,000,000.00
合计	24,083,209.66

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年05月18日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	163,590,342.10	163,590,342.10
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	563,846.33	117,251.13
本期赎回（以“-”号填列）	-142,793,754.92	-142,793,754.92

本期末	21,360,433.51	20,913,838.31
-----	---------------	---------------

#### 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	210,911.45	235,683.75	446,595.20
本期利润	-135,775.87	-56,058.87	-191,834.74
本期基金份额交易产生的变动数	67,636.13	-79,748.05	-12,111.92
其中：基金申购款	-32,087.06	6,461.44	-25,625.62
基金赎回款	99,723.19	-86,209.49	13,513.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	142,771.71	99,876.83	242,648.54

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年05月18日
活期存款利息收入	28,113.65
定期存款利息收入	889,475.01
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	23.39
合计	917,612.05

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元



项目	本期
	2018年01月01日至2018年05月18日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	426,614.77
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	426,614.77

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日至2018年05月18日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	239,463,581.82
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	233,551,671.01
减：应收利息总额	5,485,296.04
买卖债券差价收入	426,614.77

#### 6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年01月01日至2018年05月18日
1. 交易性金融资产	-171,472.59
——股票投资	-
——债券投资	-195,087.67
——资产支持证券投资	23,615.08
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-171,472.59

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年05月18日
基金赎回费收入	61,081.55
转换费收入	1,520.72
合计	62,602.27

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对于持续持有期少于30日的投资人的赎回费全额计入基金资产，对持续持有期少于3个月的投资人，应将不低于赎回费总额75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人，应将不低于赎回费总额50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

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。

## 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年05月18日
交易所市场交易费用	13.10
银行间市场交易费用	1,650.00
合计	1,663.10

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年05月18日
审计费用	22,684.44
信息披露费	60,493.68
汇划手续费	6,218.03
帐户维护费	18,000.00
查询服务费	600.00
合计	107,996.15

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，关联方关系未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

富安达基金管理有限公司（“富安达基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
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
南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司（“南京河西”）	基金管理人的股东
富安达资产管理（上海）有限公司（“富安达资管”）	基金管理人的全资子公司

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

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。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

###### 6.4.10.1.4 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。

##### 6.4.10.2 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 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。

#### 6.4.10.2.2 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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况--非货币市场基金

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
1	2018-04-23	2018-04-23	0.200	2,696,905.75	-	2,696,905.75	-
合计			0.200	2,696,905.75	-	2,696,905.75	-

#### 6.4.12 期末（2018年05月18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

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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 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市场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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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

本基金为混合型证券投资基金，其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。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。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行浦发银行，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。

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

#### 6.4.13.2.1 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 2018年05月18日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	30,045,000.00
A-1以下	-	-
未评级	-	50,188,000.00
合计	-	80,233,000.00

未评级债券为国债、政策性金融债、和超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年05月18日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	82,813,000.00
合计	-	82,813,000.00

#### 6.4.13.2.3 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 2018年05月18日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	1,560,213.60
合计	-	1,560,213.60

未评级债券为国债。

#### 6.4.13.3 流动性风险



流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上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股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年05月18日	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	320,330.27	-	-	-	-	-	320,330.27
存出保证金	3,869.06	-	-	-	-	-	3,869.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	52,845,439.27	-	-	-	-	-	52,845,439.27
应收利息	-	-	-	-	-	71,877.83	71,877.83
资产总计	53,169,638.60	-	-	-	-	71,877.83	53,241,516.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,734,088.92	7,734,088.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	53,225.63	53,225.63
应付托管费	-	-	-	-	-	8,870.94	8,870.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,158.26	1,158.26
应交税费	-	-	-	-	-	529.51	529.51
其他负债	-	-	-	-	-	24,083,209.66	24,083,209.66
负债总计	-	-	-	-	-	31,881,082.92	31,881,082.92
利率敏感度缺口	53,169,638.60	-	-	-	-	-31,809,205.09	21,360,433.51
上年度末2017年12月31日	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	1,026,077.09	-	-	-	-	-	1,026,077.09
存出保证金	495.18	-	-	-	-	-	495.18
交易性金融资产	74,156,000.00	78,853,000.00	11,597,213.60	-	-	-	164,606,213.60
应收利息	-	-	-	-	-	3,300,428.67	3,300,428.67
应收申购款	-	-	-	-	-	9.88	9.88
资产总计	75,182,572.2	78,853,000.0	11,597,213.6	-	-	3,300,438.55	168,933,224.4

	7	0	0				2
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	410,053.36	410,053.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	174,897.66	174,897.66
应付托管费	-	-	-	-	-	29,149.60	29,149.60
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,124.64	4,124.64
其他负债	-	-	-	-	-	222,323.42	222,323.42
负债总计	-	-	-	-	-	840,548.68	840,548.68
利率敏感度缺口	75,182,572.27	78,853,000.00	11,597,213.60			2,459,889.87	168,092,675.74

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。		
假设	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。		
假设	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 2018年05月18日	上年度末 2017年12月31日
	利率下降25个基点	-	54,720.04
	利率上升25个基点	-	-54,660.79

截至2018年5月18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。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合联储模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资比例范围为：股票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不低于5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年05月18日		上年度末 2017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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	164,606,213.6 0	97.93
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	-	-	164,606,213.6 0	97.93

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

截至报告期末，本基金未持有交易性权益类投资（2017年12月31日：同），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2017年12月31日：同）。

#### 6.4.14 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	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
11	600845	宝信软件	2,600	68,510.00	0.48
12	600521	华海药业	2,500	66,725.00	0.46
13	002419	天虹股份	3,769	55,027.40	0.38
14	002304	洋河股份	400	52,640.00	0.37
15	000681	视觉中国	1,700	48,790.00	0.34
16	002410	广联达	1,646	45,643.58	0.32
17	601877	正泰电器	2,000	44,640.00	0.31
18	300037	新宙邦	1,659	44,444.61	0.31
19	000895	双汇发展	1,600	42,256.00	0.29
20	300073	当升科技	1,200	40,872.00	0.28
21	002007	华兰生物	1,200	38,592.00	0.27
22	600581	八一钢铁	7,128	36,851.76	0.26

23	601939	建设银行	5,600	36,680.00	0.25
24	002044	美年健康	1,500	33,900.00	0.24
25	002003	伟星股份	3,640	30,830.80	0.21
26	600036	招商银行	1,100	29,084.00	0.20
27	603156	养元饮品	311	19,300.66	0.13
28	300451	创业软件	829	12,932.40	0.09
29	603040	新坐标	300	12,597.00	0.09
30	002327	富安娜	1,115	12,086.60	0.08
31	002024	苏宁易购	776	10,926.08	0.08
32	603799	华友钴业	100	9,747.00	0.07

#### 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所有股票投资明细

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	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	
招商 证券	2	7,040,537.99	100.0 0%	6,556.97	100.0 0%	-

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%	-	-	-	-	-	-

## 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2017年12月31日基金净值公告	指定报刊及公司网站	2018-01-01
2	关于富安达基金因网上交易系统维护暂停相关业务的公告	公司网站	2018-01-04
3	关于富安达基金官方网站系统维护的公告	公司网站	2018-01-19
4	富安达长盈保本混合型证券投资基金2017年第4季度报告	指定报刊及公司网站	2018-01-20
5	富安达基金管理有限公司关于参与大泰金石基金销售有限公司费率优惠活动的公告	指定报刊及公司网站	2018-02-02
6	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加华金证券为代销机构并开通定投及转换业务的公告	指定报刊及公司网站	2018-02-27
7	关于停止富安达基金管理有限公司易宝支付网上交易业务的公告	公司网站	2018-03-06
8	关于富安达基金网上直销部分农业银行卡升级维护的通知	公司网站	2018-03-17

9	关于富安达基金因维护网上交易系统暂停相关业务的公告	公司网站	2018-03-21
10	富安达基金管理有限公司关于修订旗下九只基金产品基金合同有关条款的公告	指定报刊及公司网站	2018-03-22
11	富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同及托管协议	指定报刊及公司网站	2018-03-22
12	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠的公告	指定报刊及公司网站	2018-03-29
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费率优惠活动的公告	指定报刊及公司网站	2018-03-30
14	富安达长盈保本混合型证券投资基金2017年年度报告正文及摘要	指定报刊及公司网站	2018-03-31
15	关于富安达基金网上直销部分华夏银行卡业务暂停的通知	公司网站	2018-04-02
16	关于富安达基金因维护网站、网上交易系统暂停相关业务的公告	公司网站	2018-04-03
17	富安达基金管理有限公司关于对短期投资行为收取短期赎回费及巨额赎回情形下转出业务规则的公告	指定报刊及公司网站	2018-04-03
18	关于富安达基金因维护网站、网上交易系统暂停相关业务的公告	公司网站	2018-04-13

19	富安达长盈保本混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊及公司网站	2018-04-14
20	关于富安达长盈保本混合型证券投资基金暂停个人投资者大额申购（含定投及转换转入）业务的公告	指定报刊及公司网站	2018-04-18
21	关于富安达长盈保本混合型证券投资基金暂停机构投资者申购（含定投及转换转入）业务的公告	指定报刊及公司网站	2018-04-18
22	富安达长盈保本混合型证券投资基金2018年第一季度报告	指定报刊及公司网站	2018-04-20
23	富安达长盈保本混合型证券投资基金2018年基金分红公告	指定报刊及公司网站	2018-04-20
24	关于富安达基金网上直销部分招商银行卡业务暂停的通知	公司网站	2018-04-24
25	富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同、合同摘要、托管协议、招募说明书	指定报刊及公司网站	2018-04-26
26	富安达长盈保本混合型证券投资基金保本期到期的第一次提示性公告	指定报刊及公司网站	2018-04-26
27	富安达基金管理有限公司关于富安达长盈保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金后运作相关业务规则的公告	指定报刊及公司网站	2018-04-26
28	富安达基金管理有限公司关	指定报刊及公司网站	2018-04-26

	于富安达长盈保本混合型证券投资基金修改基金合同的公告		
29	富安达长盈保本混合型证券投资基金保本周期到期的第二次提示性公告	指定报刊及公司网站	2018-05-02
30	关于富安达基金系统升级维护的公告	公司网站	2018-05-03
31	富安达基金管理有限公司关于举行2018年投资者网上集体接待日活动的通知	指定报刊及公司网站	2018-05-08
32	关于富安达基金系统升级维护的公告	公司网站	2018-05-11
33	关于富安达基金系统升级维护的公告	公司网站	2018-05-17
34	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与银河证券申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	指定报刊及公司网站	2018-05-18
35	富安达基金管理有限公司关于督察长变更的公告	指定报刊及公司网站	2018-05-19
36	富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊及公司网站	2018-05-22
37	富安达基金管理有限公司关于富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金份额折算结果的公告	指定报刊及公司网站	2018-05-22
38	关于富安达基金系统升级维护的公告	公司网站	2018-05-25
39	关于富安达基金网上直销部分招商银行卡业务暂停的通知	公司网站	2018-05-29

40	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与建设银行直联网上直销交易定期定额投资手续费率优惠的公告	指定报刊及公司网站	2018-06-01
41	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费率优惠活动的公告	指定报刊及公司网站	2018-06-30
42	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网上银行定期定额投资手续费率优惠活动的公告	指定报刊及公司网站	2018-06-30

## § 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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准富安达长盈保本混合型证券投资基金设立的文件：  
《富安达长盈保本混合型证券投资基金招募说明书》；  
《富安达长盈保本混合型证券投资基金基金合同》；  
《富安达长盈保本混合型证券投资基金托管协议》。
2. 保本基金转型后的相关法律文件：  
《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；  
《富安达长盈灵活配置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托管协议》。
3. 《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；



5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
7. 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  
二〇一八年八月二十九日