

富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金

2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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:2019 年 03 月 30 日

§ 1 重要提示

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2019年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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1月1日起至12月31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	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	21,560,110.24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
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	富安达基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
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）021-61870666	95528
传真	021-61870888	021-63602540

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(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	2018年05月19日（转型后首日） - 2018年12月31日
本期已实现收益	-2,043,677.55
本期利润	-2,787,423.60
加权平均基金份额本期利润	-0.1216
本期基金份额净值增长率	-11.30%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0923
期末基金资产净值	19,120,755.92
期末基金份额净值	0.887

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日转型。

④期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去三个月	-6.34%	0.94%	-6.22%	0.97%	-0.12%	-0.03%
过去六个月	-10.04%	0.77%	-6.87%	0.89%	-3.17%	-0.12%

自基金合同生效起至今	-11.30%	0.70%	-12.02%	0.86%	0.72%	-0.16%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	--------

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

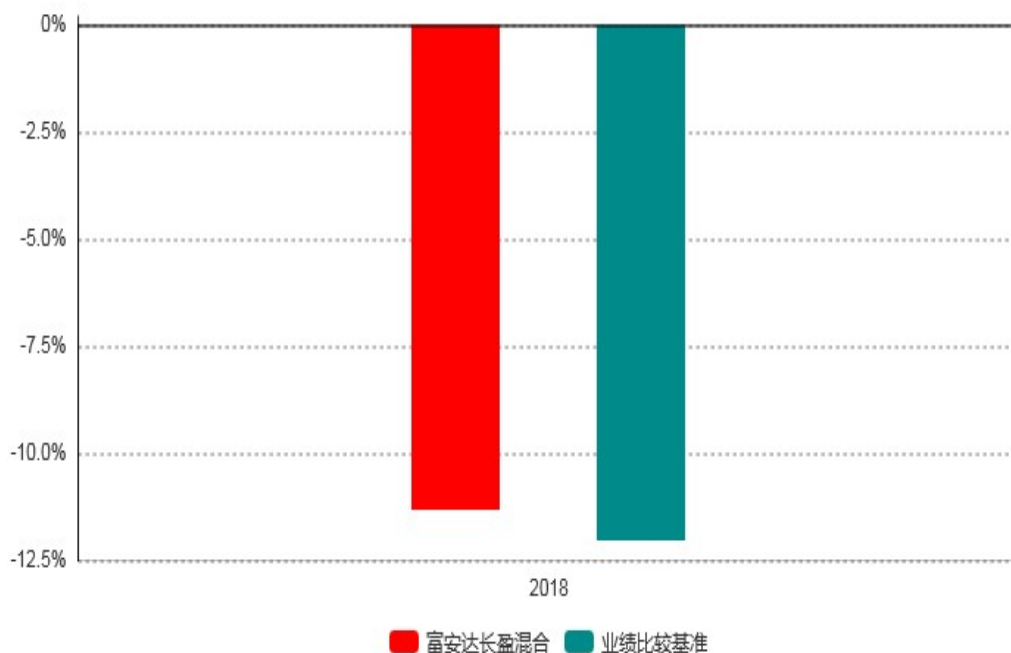
富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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，建仓截止日为2018年11月18日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（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	2018年01月01日 - 2018年05月1 8日	2017年	2016年5月11日(基金合同 生效日) -2016年12月31 日
本期已实现收益	2,062,471.98	1,194,825.14	3,813,006.84
本期利润	1,890,999.39	8,069,158.87	-2,889,854.30
加权平均基金份额本期利润	0.0134	0.0393	-0.0093
本期加权平均净值利润率	1.30%	3.93%	-0.93%
本期基金份额净值增长率	-0.81%	4.26%	-1.40%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年 末	2016年末
期末可供分配利润	210,911.45	2,300,8	-3,392,084.33

		11.53	
期末可供分配基金份额利润	0.0099	0.0141	-0.0138
期末基金资产净值	21,360,433.51	168,09 2,675.7 4	243,178,720.16
期末基金份额净值	1.0000	1.0280	0.9860
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年 末	2016年末
基金份额累计净值增长率	-	2.80%	-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期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

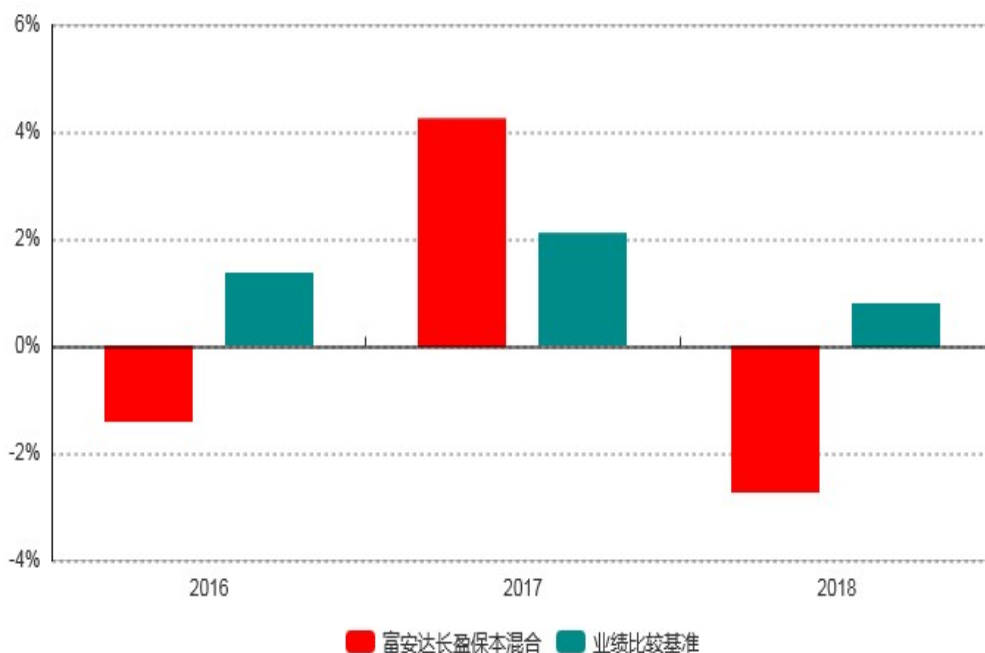
富安达长盈保本混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年05月11日-2018年05月18日)



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018年	0.200	2,696,905.75	-	2,696,905.75	-
合计	0.200	2,696,905.75	-	2,696,905.75	-

§ 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12月31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

资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金。

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)。
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月起任富安达长盈灵活配置混合型基金、富安达新动力灵活配置混合型基金、富安达行业轮动灵活配置混合型基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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

2018年市场经历了较大幅度的下跌，其中沪深300下跌25%，创业板指下跌28.65%，全年无行业录得正收益。在经历了上半年金融去杠杆和中美贸易摩擦的爆发，市场风险偏好降至冰点，股票估值跌至历史底部区域。随着10月国家纾困基金、稳杠杆以及鼓励大力发展资本市场创新等一系列政策出台，A股市场逐步企稳。本基金自5月转型为灵活配置基金后，以防御策略为主，控制仓位，主要配置了低估值的金融、地产、新能源以及部分消费品，同时配置了短期限利率类品种。

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12月31日，富安达长盈混合基金份额净值为0.887元；自2018年5月19日至2018年12月31日本基金份额净值增长率为-11.30%，同期业绩比较基准收益率为-12.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济层面，我们认为2019年经济增速仍处于下行周期，但货币政策转向宽松，去杠杆已告一段落。十年期国债收益率下行，1月社融规模增速加快，结构亦有所优化。相比2018年，外围经济环境也有所缓和，美国货币政策开始转向鸽派，中美贸易谈判有望有新进展，人民币贬值压力趋缓。从大类资产对比角度，我们认为权益类资产的风险溢价已有足够吸引力。我们主要看好以下两类机会：1、经济下行周期配置股息率高、低估值优质公司 2、以目前相对合理的价格配置增长确定性高的新经济行业龙头，比如5G、电子、新能源、高端制造等。

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。

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，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。针对该情形，本基金管理人的解决方案为：稳健运作，做好基金业绩，稳定基金规模；积极沟通，整合资源，有序推进营销工作。上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。

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”）在对富安达长盈保本混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金（由“富安达长盈保本混合型证券投资基金”转型而来）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，对富安达长盈保本混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金（由“富安达长盈保本混合型证券投资基金”转型而来）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 审计报告(转型后)

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表，2018年5月19日（基金转型日）至2018年12月31日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。注册会计师陈熹、都晓燕于2019年3月28日签字出具了普华永道中天审字(2019)第20950号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 6 审计报告(转型前)

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了富安达长盈保本混合型证券投资基金的财务报表，包括2018年5月18日（基金转型日前日）的资产负债表，2018年1月1日至2018年5月18日（基金转型日前日）止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。注册会计师陈熹、都晓燕于2019年3月28日签字出具了普华永道中天审字(2019)第20951号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日
-----	--------------------

资产：	
银行存款	7,208,659.41
结算备付金	326,733.88
存出保证金	26,170.15
交易性金融资产	11,655,074.95
其中：股票投资	10,602,463.75
基金投资	-
债券投资	1,052,611.20
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	233,612.43
应收利息	30,470.54
应收股利	-
应收申购款	398.07
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	19,481,119.43
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	237.27
应付赎回款	72,498.36
应付管理人报酬	25,264.61
应付托管费	4,210.77
应付销售服务费	-

应付交易费用	27,984.34
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	230,168.16
负债合计	360,363.51
所有者权益：	
实收基金	21,111,526.07
未分配利润	-1,990,770.15
所有者权益合计	19,120,755.92
负债和所有者权益总计	19,481,119.43

注：

1. 报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.887元，基金份额总额21,560,110.24份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2018年5月19日（基金转型日）至2018年12月31日止期间

7.2 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12月31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12月31日
一、收入	-2,264,521.78
1. 利息收入	201,755.39
其中：存款利息收入	58,690.17
债券利息收入	23,226.18
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	119,839.04
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-1,773,520.79

其中：股票投资收益	-1,812,187.80
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	38,667.01
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-743,746.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	50,989.67
减：二、费用	522,901.82
1. 管理人报酬	201,126.46
2. 托管费	33,521.09
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	120,815.11
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	167,439.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,787,423.60
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,787,423.60

7.3 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12月31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12月31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)	-	-2,787,423.60	-2,787,423.60
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)	197,687.76	350,058.25	547,746.01
其中:1.基金申购款	20,964,930.23	68,842.01	21,033,772.24
2.基金赎回款	-20,767,242.47	281,216.24	-20,486,026.23
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)	21,111,526.07	-1,990,770.15	19,120,755.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

蒋晓刚

沈伟青

孙爱民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由富安达长盈保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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。原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，原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。

根据原基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2018年4月26日发布的《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修改基金合同的公告》，自2018年5月19日起，原基金更名为富安达长盈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基金合同》失效，《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同日起生效。本基金为契约型开放式，存续期不定。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。原基金以2018年5月18日为基金份额折算基准日，折算前基金份额总额为20,913,838.31份，折算前基金份额净值为1.021元，折算比例为1.021354052，折算后基金份额总额为21,360,433.51份，于2018年5月19日正式变更为本基金基金份额，折算后基金份额净值为1.000元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、衍生工具(权证、股指期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0-95%，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债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的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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2019年3月29日批准报出。

7.4.2 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》、《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2018年12月31日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年5月19日(基金转型日)至2018年12月31日止期间的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12月31日的财务状况以及2018年5月19日(基金转型日)至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

本报告期内，关联方关系未发生变化。

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、登记机构、基金销售机构
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
上海浦发银行股份有限公司(“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	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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**7.4.8.1.1 股票交易**

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 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12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	201,126.46
其中：支付销售机构的客户维护费	19,627.09

注：支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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。

7.4.8.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	33,521.09

注：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。

7.4.8.3 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发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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12月31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	7,208,659.41	55,090.33

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股 票	股 票	停 牌	停 牌	期 末	复 牌	复 牌	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备 注
--------	--------	--------	--------	--------	--------	--------	-----------	------------	------------	--------

代码	名称	日期	原因	估值单价	日期	开盘单价				
600030	中信证券	2018-12-25	重要事项未公告	16.01	2019-01-10	17.15	5,053	83,521.58	80,898.53	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为10,521,565.22元，属于第二层次的余额为1,133,509.73元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 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	本期末 2018年05月18日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
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

负债和所有者权益	本期末 2018年05月18日	上年度末 2017年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
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
所有者权益：		
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

注：

1. 报告截止日2018年5月18日(基金转型日前日)，基金份额净值1.000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(基金转型日前日)止期间。

7.2 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	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12月31日
一、收入	2,773,768.67	11,493,364.29
1. 利息收入	2,456,024.22	9,706,278.80
其中：存款利息收入	917,612.05	1,986,780.43
债券利息收入	1,408,327.55	7,133,813.29
资产支持证券利息收入	-	261,024.67
买入返售金融资产收入	130,084.62	324,660.41
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	426,614.77	-5,294,782.36
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	426,614.77	-5,280,822.34
资产支持证券投资收益	-	-13,960.02
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	6,874,333.73
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	207,534.12
减：二、费用	882,769.28	3,424,205.42

1. 管理人报酬	654,838.92	2,475,236.01
2. 托管费	109,139.82	412,539.38
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,663.10	4,320.24
5. 利息支出	8,086.99	262,662.43
其中: 卖出回购金融资产支出	8,086.99	262,662.43
6. 税金及附加	1,044.30	-
7. 其他费用	107,996.15	269,447.36
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,890,999.39	8,069,158.87
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,890,999.39	8,069,158.87

7.3 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	-	-2,696,905.75	-2,696,905.75

(净值减少以“-”号填列)			
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12月31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)	-	8,069,158.87	8,069,158.87
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)	-82,980,462.39	-174,740.90	-83,155,203.29
其中：1. 基金申购款	468,872.86	6,788.10	475,660.96
2. 基金赎回款	-83,449,335.25	-181,529.00	-83,630,864.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	163,590,342.10	4,502,333.64	168,092,675.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

根据本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于 2018 年 4 月 26 日发布的《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修改基金合同的公告》，自 2018 年 5 月 19 日起，本基金更名为非保本的混合型基金，即“富安达长盈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基金合同》失效，《富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

根据本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于 2018 年 5 月 22 日发布的基金份额折算结果的公告，本基金以 2018 年 5 月 18 日为基金份额折算基准日，折算前基金份额总额为 20,913,838.31 份，折算前基金份额净值为 1.021 元，折算比例为 1.021354052，折算后基金份额总额为 21,360,433.51 份，折算后基金份额净值为 1.000 元。本基金的基金管理人已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算并进行了变更登记。

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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2019 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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。

经中国证监会批准，基金管理人富安达基金管理有限公司将本基金转型为富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年5月18日(基金转型日前日)止期间的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(基金转型日前日)的财务状况以及2018年1月1日至2018年5月18日(基金转型日前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 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[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，包括买卖债券的差价收入，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

本报告期内，关联方关系未发生变化。

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、登记机构、基金销售机构
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
上海浦发银行股份有限公司(“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	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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.1.4 债券回购交易

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回购交易。

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年05月18日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	654,838.92	2,475,236.01
其中：支付销售机构的客户维护费	57,635.95	227,595.33

注：支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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。

7.4.8.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	109,139.82	412,539.38

注：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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018年01月01日至2018年05月18日						
银行间市场交易的各关联方	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

名称						
浦发银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	-	-	19,943,180.00	25,275.00	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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05月18日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31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	1,026,077.09	26,235.40

注：本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018年05月18日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年5月18日(基金转型日前日)，本基金未持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(2017年12月31日：第二层次164,606,213.60元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年5月18日(基金转型日前日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告(转型后)

8.1 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	10,602,463.75	54.42
	其中：股票	10,602,463.75	54.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,052,611.20	5.40
	其中：债券	1,052,611.20	5.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,535,393.29	38.68
8	其他各项资产	290,651.19	1.49
9	合计	19,481,119.43	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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	163,406.80	0.85
B	采矿业	395,724.00	2.07
C	制造业	4,585,750.12	23.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	504,255.74	2.64

F	批发和零售业	205,071.60	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	57,285.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,173,619.25	6.14
J	金融业	1,276,617.62	6.68
K	房地产业	1,578,818.72	8.26
L	租赁和商务服务业	42,140.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	88,510.15	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	531,264.75	2.78
S	综合	-	-
	合计	10,602,463.75	55.45

8.3 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	600048	保利地产	42,023	495,451.17	2.59
2	002146	荣盛发展	51,562	409,917.90	2.14
3	300253	卫宁健康	32,834	409,111.64	2.14
4	000002	万科A	13,900	331,098.00	1.73
5	601288	农业银行	91,947	331,009.20	1.73
6	002327	富安娜	41,076	308,480.76	1.61
7	601229	上海银行	24,929	278,955.51	1.46
8	603359	东珠生态	16,873	276,379.74	1.45
9	002624	完美世界	9,870	274,879.50	1.44
10	002152	广电运通	48,800	273,768.00	1.43

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富安达基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	1,654,995.00	8.66
2	002410	广联达	1,187,830.00	6.21
3	300253	卫宁健康	1,152,839.94	6.03
4	600760	中航沈飞	1,144,564.00	5.99
5	300602	飞荣达	981,958.00	5.14
6	600519	贵州茅台	931,171.00	4.87
7	000651	格力电器	816,938.00	4.27
8	601601	中国太保	758,769.85	3.97
9	000333	美的集团	720,938.00	3.77
10	603019	中科曙光	690,614.00	3.61
11	601398	工商银行	677,548.00	3.54
12	601288	农业银行	640,366.00	3.35
13	002624	完美世界	599,271.00	3.13
14	300113	顺网科技	598,739.00	3.13
15	300144	宋城演艺	591,107.00	3.09
16	600271	航天信息	583,014.00	3.05
17	000789	万年青	571,678.00	2.99
18	002449	国星光电	564,856.00	2.95
19	002110	三钢闽光	564,296.00	2.95
20	600845	宝信软件	561,969.46	2.94
21	002146	荣盛发展	553,850.00	2.90
22	601012	隆基股份	542,447.00	2.84
23	002327	富安娜	540,628.00	2.83
24	000968	蓝焰控股	539,687.00	2.82
25	601229	上海银行	528,586.00	2.76

26	002024	苏宁易购	518,332.00	2.71
27	002384	东山精密	518,317.00	2.71
28	300451	创业慧康	500,644.00	2.62
29	000895	双汇发展	472,345.00	2.47
30	300308	中际旭创	459,527.00	2.40
31	601225	陕西煤业	449,933.00	2.35
32	002456	欧菲科技	449,052.00	2.35
33	000547	航天发展	433,457.00	2.27
34	300070	碧水源	429,943.00	2.25
35	603799	华友钴业	419,907.00	2.20
36	600438	通威股份	416,477.00	2.18
37	300251	光线传媒	416,467.00	2.18
38	601318	中国平安	409,071.00	2.14
39	600702	舍得酒业	403,079.00	2.11
40	603359	东珠生态	402,361.40	2.10
41	600803	新奥股份	396,514.00	2.07
42	601166	兴业银行	387,222.00	2.03
43	300166	东方国信	385,821.00	2.02
44	300012	华测检测	385,638.00	2.02
45	603328	依顿电子	384,102.00	2.01

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。

8.4.2 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	002410	广联达	1,132,871.34	5.92
2	600048	保利地产	1,110,042.80	5.81
3	300602	飞荣达	945,904.20	4.95
4	600760	中航沈飞	862,296.78	4.51
5	300253	卫宁健康	709,701.56	3.71
6	600519	贵州茅台	692,360.00	3.62

7	603019	中科曙光	617,778.56	3.23
8	601398	工商银行	615,784.46	3.22
9	300144	宋城演艺	598,788.26	3.13
10	000968	蓝焰控股	590,263.74	3.09
11	002110	三钢闽光	564,706.09	2.95
12	601601	中国太保	558,199.39	2.92
13	601012	隆基股份	531,589.59	2.78
14	000651	格力电器	498,604.47	2.61
15	300113	顺网科技	490,645.02	2.57
16	000333	美的集团	467,970.38	2.45
17	000789	万年青	457,785.40	2.39
18	002024	苏宁易购	444,821.44	2.33
19	300070	碧水源	441,441.00	2.31
20	600271	航天信息	430,704.80	2.25
21	000895	双汇发展	407,696.92	2.13
22	600803	新奥股份	398,959.53	2.09
23	002456	欧菲科技	394,490.63	2.06
24	300451	创业慧康	393,964.23	2.06
25	600845	宝信软件	382,741.78	2.00

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。

8.4.3 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	48,486,638.23
卖出股票收入（成交）总额	35,324,991.83

“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。

8.5 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	1,052,611.20	5.51
	其中：政策性金融债	1,052,611.20	5.51
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	1,052,611.20	5.51

8.6 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	1,052,611.20	5.51

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，在报告编制日前一年内除上海银行（601229）外，没有受到公开谴责、处罚的情形。

2018年1月4日，中国银行业监督管理委员会上海监管局依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，作出沪银监罚决字（2018）1号行政处罚决定书，对上海银行责令改正，并处罚款人民币50万元。主要违法违规事实如下：2015年，

该行对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎，部分理财资金用于增资和缴纳土地出让金，与合同约定用途不一致。

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下，经公司审慎研究评估，将该股票纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

8.12.2 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。

8.12.3 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	26,170.15
2	应收证券清算款	233,612.43
3	应收股利	-
4	应收利息	30,470.54
5	应收申购款	398.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	290,651.19

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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 投资组合报告（转型前）

8.1 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。

8.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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。

8.4.2 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。

8.4.3 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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本基金本报告期末未持有股票资产。

8.12.3 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
---	----	-----------

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 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
719	29,986.25	353,043.23	1.64%	21,207,067.01	98.36%

9.2 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%

9.3 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 基金份额持有人信息 (转型前)

9.1 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%

9.2 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%

9.3 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。

§ 10 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	21,408,536.95
减：本报告期基金总赎回份额	21,208,860.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,560,110.24

§ 10 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

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，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，公司聘任李理想同志担任公司督察长。

2018年7月18日，公司股东会选举胥海先生担任股东董事。

2018年7月19日，公司发布《富安达基金管理有限公司关于总经理任职的公告》，公司聘任胥海先生为总经理。

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。

本报告期内，本基金托管人的重大人事变动：

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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）。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为70,000元人民币。

截至本报告期末，该事务所已向本基金提供3年的审计服务。

11.6 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12月31日

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	83,811,630.06	100.00%	78,053.95	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。

11.7.2 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%	511,100,000.00	100.00%	-	-	-	-

转型前

报告期2018年01月01日 - 2018年05月18日

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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。

11.7.2 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%	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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

二〇一九年三月三十日