

富安达富利纯债债券型证券投资基金

2019 年年度报告

2019 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2020 年 04 月 20 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年4月17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经审计，毕马威华振会计师事务所(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。

本报告期自2019年7月23日（基金合同生效日）起至2019年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
8.7 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	49
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	49
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	49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
8.12 投资组合报告附注.....	50
§9 基金份额持有人信息.....	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§10 开放式基金份额变动.....	51
§11 重大事件揭示.....	52
11.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4 基金投资策略的改变.....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
11.8 其他重大事件.....	56
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§13 备查文件目录.....	59
13.1 备查文件目录.....	59
13.2 存放地点.....	59
13.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达富利纯债债券型证券投资基金
基金简称	富安达富利纯债债券
基金主代码	007520
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年07月23日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	209,046,800.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求资产长期稳健增值的基础上，力争为份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益
投资策略	本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、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，判断和预测经济发展周期及趋势，构建和调整固定收益证券投资组合。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	李理想	陆志俊
	联系电话	021-61870999	95559

人	电子邮箱	service@fadfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		蒋晓刚	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2019年07月23日（基金合同生效日）- 2019年12月31日
本期已实现收益	1, 152, 126. 78

本期利润	1,160,879.96
加权平均基金份额本期利润	0.0087
本期加权平均净值利润率	0.87%
本期基金份额净值增长率	0.86%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末
期末可供分配利润	1,805,550.30
期末可供分配基金份额利润	0.0086
期末基金资产净值	210,852,350.53
期末基金份额净值	1.0086
3.1.3 累计期末指标	2019年末
基金份额累计净值增长率	0.86%

注：

1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3. 期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	0.83%	0.06%	0.61%	0.04%	0.22%	0.02%
自基金合同生效起至今	0.86%	0.06%	0.82%	0.04%	0.04%	0.02%

注：

1. 本基金业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率
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：

$$\text{Return}_t = \text{中债综合全价（总值）指数收益率}_t \div \text{中债综合全价（总值）指数收益率}_{(t-1)} - 1]$$

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

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

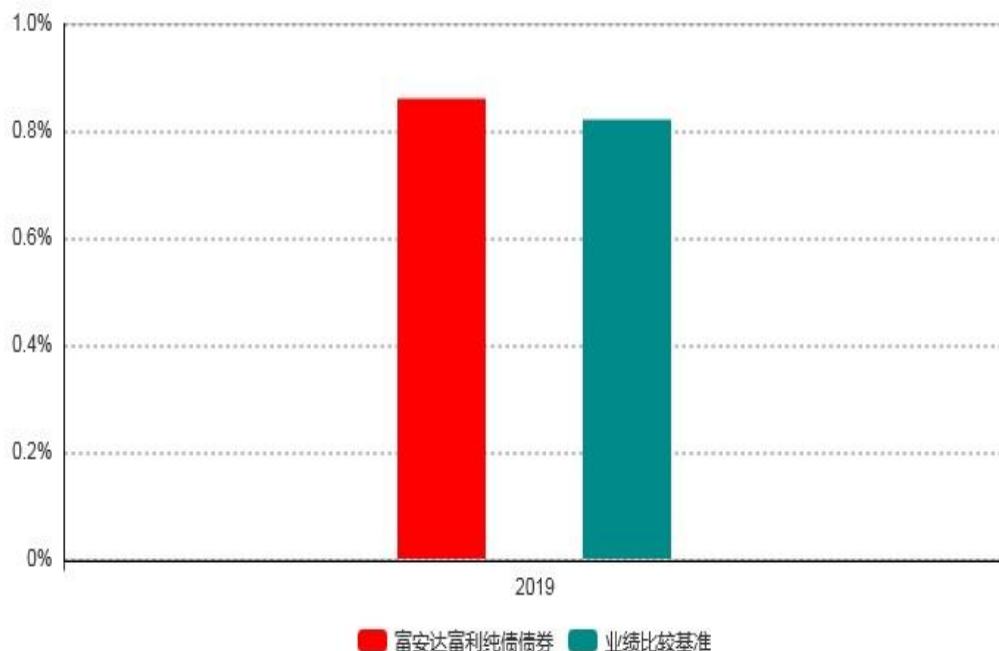
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富安达富利纯债债券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



注：本基金于2019年7月23日成立，本基金建仓期为本基金合同生效之日起六个月，建仓截止日为2020年1月22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

本基金成立于2019年7月23日，自基金合同生效日至本报告期末无利润分配事项。

§ 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2019年12月31日，公司共管理十二只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金。

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）	2019-07-23	-	15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）、富安达富利纯债债券型证券投资基金的基金经理。
张凯瑜	本基金的基金经理	2019-07-23	-	11年	硕士。历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理员；爱建证券有限责

					任公司固定收益部债券交易员。2011年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年1月起任富安达现金通货币市场证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理（2013年10月25日至2016年10月25日期间）、富安长达盈保本混合型证券投资基金的基金经理（2016年7月22日至2018年5月21日期间）、富安达富利纯债债券型证券投资基金的基金经理。
张帅	本基金的基金经理	2019-08-07	-	3年	历任银行间市场清算所股份有限公司产品开发部产品经理；光大证券股份有限公司风险管理部风控经理；恒丰银行股份有限公司资金营运中心债券自营交易员；国金证券上海证券资产管理分公司固定收益部投资经理。2018年10月加入富安达基金管理有限公司。2019年8月起任富安达富利纯债债券型证券投资基金的基金经理。

注：

1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《富安达消费主题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

2019年,债券市场收益率整体震荡下行,第一季度由于经济及金融数据好于预期,带动收益率上行,十年国债由年初3.17%上行至4月下旬3.43%左右。5月下旬包商银行被接管,5月经济数据出现超预期下行,债券市场收益率见顶后开始下行,8月中美经贸关系再次恶化,特朗普表示将对我国3000亿美元货物加征10%关税,并将对5500亿商品加征5%关税,带动收益率持续下行,十年国债触及年内最低点至3%左右。国内宏观政策压力加大,并于9月施行全面及定向降准,政策落地后,市场收益率见底反弹。市场担忧持续上涨的猪价可能会触发阶段性的食品通胀并阻碍货币政策的宽松倾向,9月中旬中美经贸关系暂时缓和,十年国债10月底最高反弹至3.30%左右。11月初央行MLF利率下调5BP,11月中旬回购利率下调5BP,债券收益率开始下行,12月下旬市场降准预期强烈,加上摊余成本基金成立较多带动配置需求,但经济数据出现越来越明显的企稳迹象,债

券收益率缓慢下行，截止年底，十年国债收盘3.14%，债券市场全年表现出明显的震荡特征。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达富利纯债债券基金份额净值为1.0086元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.86%，同期业绩比较基准收益率为0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2020年，虽然2019年四季度国内经济及金融数据逐渐表现出阶段性企稳的迹象，而且全球其他主要经济体制造业及出口数据也出现企稳反弹，但是1月春节前后开始快速扩散的新型冠状病毒肺炎疫情打破了国内外经济体的企稳态势，我国政府采取了果断快速的应对措施，在2月中旬开始疫情数据开始好转，但同时也付出了巨大的经济代价，特别是对第三产业冲击明显。目前估算一季度GDP同比增速放缓，导致第二、三、四季度经济增长压力巨大，为此财政及货币政策近期陆续出台，东部疫情较轻地区开始全面复工，但在不刺激地产的情况下，仅仅作用于基建投资及中小企业，预计经济刺激的效果很难显著。此外，国外疫情却快速恶化，导致全球金融市场大幅动荡并导致美债收益率曲线再次倒挂，十年美债挑战2016年最低点，从而导致美联储降息概率上升，综合起来，市场回购利率及短期收益率已经触及或低于2016年低位，中长端仍有一定的博弈空间，而收益率后期走势主要依仗于国内宏观刺激政策。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设，强化内部管理，不断提升自身合规风控能力。报告期内，公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，强化内控基础建设；牵头开展了多形式的合规培训，强化员工职业道德教育和合规意识培育，从源头上防范合规风险；建立健全防控内幕交易机制，确保基金投资的独立性、公平性和合规性；加强业务日常合规审核和合规监测，并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查，确保各项法规和管理制度有效落实，使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全全面风险管理体系，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保护基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在富安达富利纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达富利纯债债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达富利纯债债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2000654号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富安达富利纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的第1页至第31页的富安达富利纯债债券型证券投资基金（以下简称“富安达富利纯债”）财务报表，包括2019年12月31日的资产负债表、自2019年7月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了富安达富利纯债2019年12月31日的财务状况以及自2019年7月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富安达富利纯债，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，</p>

	为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>富安达富利纯债管理人富安达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)对其他信息负责。其他信息包括富安达富利纯债2019年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估富安达富利纯债的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非富安达富利纯债计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督富安达富利纯债的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富安达富利纯债持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富安达富利纯债不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内

容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富安达富利纯债持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报

	<p>表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富安达富利纯债不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	黄小熠、汪霞
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
审计报告日期	2020-04-17

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富安达富利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	184,696.84
结算备付金		26,000,000.00
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	91,247,000.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		91,247,000.00

资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	83,515,765.28
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	3,086,846.22
应收股利		-
应收申购款		8,797,614.08
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		212,831,922.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,761,245.88
应付管理人报酬		28,388.77
应付托管费		9,462.89
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	16,876.97
应交税费		13,597.38
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	150,000.00
负债合计		1,979,571.89
所有者权益:		

实收基金	7.4.7.9	209,046,800.23
未分配利润	7.4.7.10	1,805,550.30
所有者权益合计		210,852,350.53
负债和所有者权益总计		212,831,922.42

注：

1. 报告截止日2019年12月31日，基金份额净值1.0086元，基金份额总额209,046,800.23份。
2. 本财务报表的实际编制期间为2019年7月23日（合同生效日）至2019年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：富安达富利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
一、收入		1,657,070.65
1. 利息收入		2,463,003.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	583,382.18
债券利息收入		1,806,245.43
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		73,376.31
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-815,747.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-815,747.19
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-

股利收益	7.4.7.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	8,753.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	1,060.74
减：二、费用		496,190.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	172,470.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	57,490.22
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.20	13,424.98
5. 利息支出		91,510.26
其中：卖出回购金融资产支出		91,510.26
6. 税金及附加		3,636.38
7. 其他费用	7.4.7.21	157,658.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,160,879.96
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,160,879.96

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达富利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019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)	249,498,917.90	-	249,498,917.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,160,879.96	1,160,879.96

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）	-40,452,117.67	644,670.34	-39,807,447.33
其中：1. 基金申购款	170,189,126.02	1,069,679.17	171,258,805.19
2. 基金赎回款	-210,641,243.69	-425,008.83	-211,066,252.52
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）	209,046,800.23	1,805,550.30	210,852,350.53

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

孙爱民

孙爱民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富安达富利纯债债券型证券投资基金（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”）《关于准予富安达富利纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2019]911号）批准，由富安达基金管理有限公司（以下简称“富安达基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2019年7月23日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为249,498,917.90份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则，《富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同》和《富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关

规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资股票、权证，也不投资可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）和可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2019年12月31日的财务状况、自2019年7月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2019年7月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持

有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平

准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产/负债、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行债券等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，每一基金份额享有同等分配权，收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政

策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股票的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	184,696.84
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	184,696.84

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	91,238,246.82	91,247,000.00	8,753.18
	合计	91,238,246.82	91,247,000.00	8,753.18
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	91,238,246.82	91,247,000.00	8,753.18

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	83,515,765.28	-
合计	83,515,765.28	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	151.39
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	3,271.50
应收债券利息	3,045,897.93
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	37,125.42
应收申购款利息	399.98
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	-
合计	3,086,846.22

注：其他为应收存出保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	16,876.97
合计	16,876.97

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	50,000.00
预提费用-信息披露费	100,000.00
合计	150,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	249,498,917.90	249,498,917.90

本期申购	170,189,126.02	170,189,126.02
本期赎回（以“-”号填列）	-210,641,243.69	-210,641,243.69
本期末	209,046,800.23	209,046,800.23

7.4.7.10 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	-	-	-
本期利润	1,152,126.78	8,753.18	1,160,879.96
本期基金份额交易产生的变动数	783,200.62	-138,530.28	644,670.34
其中：基金申购款	1,304,976.23	-235,297.06	1,069,679.17
基金赎回款	-521,775.61	96,766.78	-425,008.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,935,327.40	-129,777.10	1,805,550.30

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	9,003.96
定期存款利息收入	569,725.83
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,451.50
其他	1,200.89
合计	583,382.18

注：其他为应收申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.13 基金投资收益

本基金在本报告期内无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益**7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31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	-815,747.19
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	-815,747.19

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	409,036,057.05
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	399,793,207.19
减：应收利息总额	10,058,597.05
买卖债券差价收入	-815,747.19

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

本基金在本报告期内无股利收益。

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	8,753.18
——股票投资	-
——债券投资	8,753.18
——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	8,753.18

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	1,060.74
基金转出费收入	0.00
其他	0.00
合计	1,060.74

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	13,424.98
合计	13,424.98

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	50,000.00

信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	4,158.26
账户维护费	3,000.00
其他	500.00
合计	157,658.26

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司（“富安达基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司（“南京证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司（“江苏交通”）	基金管理人的股东
南京市河西新城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

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	172,470.59
其中：支付销售机构的客户维护费	29,698.65

注：支付基金管理人富安达基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	57,490.22

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金合同生效日（2019年07月23日）持有的基金份额	9,999,200.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	9,975,059.86
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00

报告期末持有的基金份额	19,974,259.86
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.55%

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
南京证券	7,999,640.00	3.83%
富安达资管	39,311,876.24	18.81%

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年07月23日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	184,696.84	9,003.96

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2019年12月31日的相关余额为人民币26,000,000.00元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2019年12月31日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2019年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2019年12月31日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2019年12月31日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2019年12月31日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

公司根据基金管理的业务特点设置内部机构和部门，建立起包含三个层次的严密、全面、有效的风险控制体系：部门和岗位层面上，以部门内控、部门互控、岗位自控和

岗位互控等方式构成了第一级风险控制；监察稽核部对各部门、各机构、各岗位、各项业务中的风险控制情况实施监督，构成了第二级风险控制；合规与风险控制委员会、督察长和风险控制委员会作为公司风险控制的领导机构，侧重于对风险的宏观控制，是整个风险控制体系中的第三个层次。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有短期信用债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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 2019年12月31日
AAA	6,078,000.00
AAA以下	75,195,000.00

AA+	22,383,000.00
AA	52,812,000.00
未评级	9,974,000.00
合计	91,247,000.00

注：未评级债券为政策性金融债券。

根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发〔2006〕95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级（含）以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的

10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市，因此均能以合理价格适时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

7.4.13.3.1 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7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

于2019年12月31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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。本基金的管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	184,696.84	-	-	-	-	-	184,696.84
结算备付金	26,000,000.00	-	-	-	-	-	26,000,000.00
交易性金融资产	36,510,000.00	-	40,496,000.00	14,241,000.00	-	-	91,247,000.00
买入返售金融资产	83,515,765.28	-	-	-	-	-	83,515,765.28
应收利息	-	-	-	-	-	3,086,846.22	3,086,846.22
应收申购款	-	-	-	-	-	8,797,614.08	8,797,614.08
资产总计	146,210,462.12	-	40,496,000.00	14,241,000.00	-	11,884,460.30	212,831,922.42
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,761,245.88	1,761,245.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,388.77	28,388.77

应付托管费	-	-	-	-	-	9,462.89	9,462.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,876.97	16,876.97
应交税费	-	-	-	-	-	13,597.38	13,597.38
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,979,571.89	1,979,571.89
利率敏感度缺口	146,210,462.12	-	40,496,000.00	14,241,000.00	-	9,904,888.41	210,852,350.53

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2019年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	86,082.73
	2. 市场利率上升25个基点	-85,689.74

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于12月31日，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与金融负债。因此，证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的变动对本基金的净值无重大影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2019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二层次的余额为91,247,000.00元，无属于第一层次及第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 8 投资组合报告

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	91,247,000.00	42.87
	其中：债券	91,247,000.00	42.87
	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	83,515,765.28	39.24
	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	26,184,696.84	12.30
8	其他各项资产	11,884,460.30	5.58
9	合计	212,831,922.42	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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债券。

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

本基金本报告期内未进行股票交易。

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

本基金本报告期内未进行股票交易。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

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	9,974,000.00	4.73

	其中：政策性金融债	9,974,000.00	4.73
4	企业债券	81,273,000.00	38.54
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	91,247,000.00	43.28

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	100222	10国开22	100,000	9,974,000.00	4.73
2	1480329	14陶都债	200,000	8,308,000.00	3.94
3	1380017	13商丘发投债	400,000	8,112,000.00	3.85
4	1380206	13临汾投资债	300,000	6,093,000.00	2.89
5	1380003	13通港闸债	300,000	6,090,000.00	2.89

8.7 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。

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。

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投资。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,086,846.22
5	应收申购款	8,797,614.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,884,460.30

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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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。

§9 基金份额持有人信息

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		机构	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
559	373,965.65	185,159,132.59	88.57%	23,887,667.64	11.43%	185,159,132.59	88.57%

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	98,216.91	0.05%

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	0~10
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0~10万份（含）。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年07月23日)基金份额总额	249,498,917.90
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	170,189,126.02

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	210,641,243.69
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	209,046,800.23

§ 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

本基金管理人的重大人事变动：

2019年1月4日，公司股东会解除靳向东同志公司董事会职务，同时聘任杜文毅同志担任公司股东董事；解除杜文毅同志公司监事会职务，同时聘任孙玮同志担任公司股东监事。

2019年5月29日，公司召开全体职工大会免去孙爱民先生职工监事职务。

2019年5月30日，公司发布《富安达基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，聘任孙爱民先生担任公司首席信息官。

2019年12月25日，公司召开全体职工大会，选举戚明龙先生为职工监事。

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。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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为毕马威华振会计师事务所(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50,000元人民币。

截至本报告期末，该事务所已向本基金提供1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，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
新时代证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国泰	1	-	-	-	-	-

君安						
安信 证券	1	-	-	-	-	-
红塔 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
华龙 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
中投 证券	2	-	-	-	-	-
华宝 证券	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
西藏 东财	2	-	-	-	-	-
东兴 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	-	-	-	-	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-

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在上述租用的券商交易单元中, (006119) 东北证券、(40533) 东北证券、(45222) 华西证券、(008920) 华西证券, 为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元: (004602) 华宝证券、(39241) 华宝证券、(004507) 方正证券。

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

本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、债券回购交易、权证交易。

11.8 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	富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同生效公告	指定媒介	2019-07-24
2	富安达基金关于参加安信证券费率优惠活动的公告(放开费率折扣限制)	指定媒介	2019-07-29
3	富安达富利纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	指定媒介	2019-08-08
4	富安达富利纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	指定媒介	2019-08-20

5	关于富安达富利纯债债券型证券投资基金参加部分销售机构定期定额投资及申购基金费率优惠活动的公告	指定媒介	2019-08-20
6	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-08-29
7	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-09-21
8	富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同	指定媒介	2019-10-22
9	富安达富利纯债债券型证券投资基金托管协议	指定媒介	2019-10-22
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	指定媒介	2019-10-22
11	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	指定媒介	2019-10-23
12	富安达富利纯债债券型证券投资基金3季度报告	指定媒介	2019-10-23
13	富安达基金管理有限公司旗下十一只基金更新产品招募说明书及摘要的提示性公告	指定媒介	2019-10-24
14	富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(二〇一九年第三号)	指定媒介	2019-10-24
15	富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(二〇一九年第三号)	指定媒介	2019-10-24
16	富安达基金关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-10-30
17	富安达基金关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-11-01

18	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-11-28
19	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	指定媒介	2019-12-11
20	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司手机银行申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	指定媒介	2019-12-30

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190826-20190902	39,998,800.00	0.00	39,998,800.00	0.00	0.00%
	2	20191108-20191224	9,999,200.00	9,975,059.86	0.00	19,974,259.86	9.55%
	3	20190925-20191227	0.00	39,311,876.24	0.00	39,311,876.24	18.81%
	4	20191225-20191231	30,001,400.00	79,356,214.66	30,001,400.00	79,356,214.66	37.96%
产品特有风险							
-							

当持有基金份额比例达到或超过20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大的冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富安达富利纯债债券型证券投资基金设立的文件：
《富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
《富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
《富安达富利纯债债券型证券投资基金托管协议》。
- 2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 3、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 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。

13.3 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）查阅。

富安达基金管理有限公司
二〇二〇年四月二十日