

---

# 富安达富利纯债债券型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 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。本中期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2021年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至6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	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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48

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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## § 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	77,713,894.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达富利纯债债券 A	富安达富利纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	007520	012603
报告期末下属分级基金的份额总额	77,709,218.50份	4,675.92份

### 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	<p>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。</p> <p>在进行固定收益类资产配置时，本基金首先通过久期配置、期限结构配置、类属配置策略来实现对固定收益类资产的配置。</p>
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
信息披露负责人	姓名	李理想
	联系电话	021-61870999
	电子邮箱	service@fadfunds.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	张睿	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金中期报告备置地点	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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	富安达富利纯债债券A	富安达富利纯债债券C
本期已实现收益	1,191,386.63	6.61
本期利润	1,973,710.33	9.13
加权平均基金份额本期利润	0.0181	0.0033
本期加权平均净值利润率	1.72%	0.31%
本期基金份额净值增长率	2.05%	0.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	4,740,012.92	296.52
期末可供分配基金份额利润	0.0610	0.0634
期末基金资产净值	82,694,429.70	4,974.96
期末基金份额净值	1.0642	1.0640
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.42%	0.24%

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

#### 富安达富利纯债债券A

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	0.42%	0.02%	-0.04%	0.03%	0.46%	-0.01%
过去三个月	1.12%	0.02%	0.45%	0.03%	0.67%	-0.01%
过去六个月	2.05%	0.02%	0.65%	0.04%	1.40%	-0.02%
过去一年	3.52%	0.02%	-0.20%	0.06%	3.72%	-0.04%
自基金合同生效起至今	6.42%	0.04%	1.41%	0.07%	5.01%	-0.03%

#### 富安达富利纯债债券C

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
自基金合同生效起至今	0.24%	0.02%	0.10%	0.03%	0.14%	-0.01%

注：

1. 本基金自 2021 年 6 月 15 日起新增 C 类份额。
2. 本基金业绩比较基准为中债综合全价（总值）指数收益率
3. 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A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年07月23日-2021年06月30日)



富安达富利纯债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年06月15日-2021年06月30日)



注：本基金自 2021 年 6 月 15 日起新增 C 类份额。

#### § 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。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。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2021年06月30日，公司共管理十六只开放式基金：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、富安达现金通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、富安长达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、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安长达三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新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、多资产投资部副总监（主持工作）兼固定收益部负责人	2019-07-23	-	17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	-	13年	硕士。历任太平人寿保险有限公司产品市场部产品管理员；爱建证券有限责任公司固定收益部债券交易员。2011年5月加入富安达基金管理有限公司。2013年1月起任富安达现金通货币市场证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金基金经理（2013年10月25日至2016年10月25日期间）、富安达长盈保本混合型证券投资基金的基金经理（2016年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	-	5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、《富安达富利纯债债券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

2021年上半年，国内债券市场各期限收益率在国内增长动能先上后下、资金面先紧后松因素的推动下呈现先上后下、整体略有下行的走势，以国开债为例，一年期共下行7bp至2.51%，三年期下行8bp至2.85%，五年期下行6bp至3.25%，十年期共下行9bp至3.49%。1月初公布的PMI值出现回落，资金面保持宽松，交易数据基于年初配置需求强的预期进行抢跑，进而带动收益率出现快速下行。1月中旬公布的社融数据显著低于预期，15日央行开展的MLF操作量低于市场预期，市场收益率反弹。1月下旬货币市场开始紧张，但央行持续开展20亿的公开市场操作，市场对央行货币政策调整产生了担忧，推动收益率上行，直至月底央行放量逆回购，收益率才出现回落。2月初，石油及有色金属持续大幅上涨屡创新高，带动了海内外市场的通胀预期，美国债券收益率显著上行。春节前央行资金投放量少于预期，国内债券市场收益率出现较快上行，十年国开最高上行至3.77%附近，接近去年下半年的最高位。2月中旬，央行发布货币政策报告引导市场关注市场操作利率以及DR007的波动而非操作量，市场情绪得以明显缓解，市场收益率见顶后回落。2月中旬至3月底，虽然海外大宗商品仍然持续上涨，美债收益率持续上行至1.7-1.8%的高位，国内债券市场未受到利空影响，5年以内的短端收益率由于资金面的宽松局面维持低位震荡，5年及以上的中长端收益率由于市场对基本面环比改善持悲观的预期，出现小幅下行，整体收益率扁平化。4月资金面保持宽松，机构配置需求强且债券一级供给量少，市场呈现只交易利好不交易利空的多头局面，虽然大宗商品持续上涨，但债券市场并不担心眼前的工业通胀，直至4月下旬收益率企稳略有反弹，市场等待美联储会议及政治局会议的进一步信号。5月上旬，在基本面数据疲软与美国通胀数据高于预期的信息交织下，收益率持续震荡，中旬大宗商品止涨下跌，债券市场出现一波下行，但月底前银行间流动性渐紧，机构对流动性前景有所担忧，导致收益率反弹。6月，机构对流动性的担忧始终存在，叠加美国经济数据持续向好，美联储提高其对今年通胀及GDP增速的预期，其货币政策基调有趋鹰迹象，并上调超额准备金利率、隔夜逆回购利率5个BP以维护短期利率在目标区间内。内外因素交织带动收益率小幅上行直至6月下旬，央行通过金融时报向市场传递将维护流动性合理充裕的政策意图，显著安抚了机构对资金面不必要的担忧，带动收益率回落至月底。二季度收益率曲线陡峭化回落，各期限收益率水平整体接近或达到年初以来的最低位。

本基金继续持有中短久期信用债与利率债。

### 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A基金份额净值为1.0642元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.05%，同期业绩比较基准收益率为0.65%；截至报告期末富安达富利纯债债券C基金份额净值为1.0640元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.24%，同期业绩比较基准收益率为0.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于新冠疫情后国内外政策抉择的不同，当前我国债券市场面临国内外增长阶段错位、货币政策阶段错位等复杂的宏观背景，当前国内增长“稳中加固”，海外美欧发达国家制造业、服务业持续复苏。国内货币政策已经于去年完成了正常化，目前“坚持稳字当头”、“保持市场流动性合理充裕”的基本思路，而海外美欧发达国家则继续保持QE规模但也进入了缩减QE的政策讨论阶段，除非再次出现新冠疫情大面积失控的局面，否则虽处于宽松政策退出的初期，但是未来政策收缩的方向是大致可以确定的。展望未来，增长层面，去年新冠疫情爆发以来，国内增长所依靠的工业及相关行业有望继续保持韧性，且财政政策空间充足，下半年国内增长方面压力不大。通胀层面，随着原油价格的持续上涨以及其它工业品的高位震荡，下半年工业通胀水平可能高位持续运行，其持续性可能超出机构预期，此外，虽然食品通胀及核心通胀绝对水平低，但已拐头向上，需要关注工业通胀向中下游的逐步传导，因此未来债券市场可能面临增长平稳、通胀上行的基本面格局。政策层面，当前主要发达国家疫苗接种进展较快，虽然有德尔塔变种病毒的侵扰，但整体上发达国家疫情情况向好，带动其经济数据持续改善，随着服务业的逐步恢复，其就业情况有望显著好转，由于就业数据的滞后性以及联储政策转向需要观察期等因素，发达国家很可能出现政策收缩晚、通胀持续久的情况，但政策收缩的方向是比较确定的，海外政策的收缩将对国内债券市场形成外溢并影响国内货币政策的取向。资金层面，当前央行并未主动投放资金，但资金面由于针对地产及地方城投企业的紧信用政策呈现持续宽松的格局，DR007以及AAA国股行一年期同业存单利率皆低于政策利率，除非下半年增长出现显著下行，否则当前资金面很难出现进一步宽松。综合来说，债券市场未来面临增长平稳+通胀高企的基本面风险，同时面临货币政策边际调整的风险，宜控制久期。

#### 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，估值委员会成员由基金经理、以及投资研究部、固定收益部、多资产投资部、监察稽核部和基金事务部指定指派人员担任委员组成，公司其他高级管理人员可列席参会。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。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但需参加估值小组会议；可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，参与估值程度和估值技术的讨论，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权。

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

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 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

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期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中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,081,271.05	4,324,948.96
结算备付金		-	-
存出保证金		450.38	-
交易性金融资产	6.4.7.2	68,604,200.00	113,061,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		68,604,200.00	113,061,000.00
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	10,300,215.45	40,360,420.54
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,039,684.55	3,479,108.42
应收股利		-	-
应收申购款		13,783.73	112,008,109.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		83,039,605.16	273,233,587.51
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020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		4,700.48	10.14
应付管理人报酬		20,283.90	21,325.17
应付托管费		6,761.30	7,108.41
应付销售服务费		0.09	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,520.25	11,444.03
应交税费		16,467.71	19,734.34
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	284,466.77	270,000.00
负债合计		340,200.50	329,622.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	77,713,894.42	261,701,754.85
未分配利润	6.4.7.10	4,985,510.24	11,202,210.57
所有者权益合计		82,699,404.66	272,903,965.42
负债和所有者权益总计		83,039,605.16	273,233,587.51

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额总额77,713,894.42份，其中A类基金份额净值1.0642元，A类基金份额77,709,218.50份；C类基金份额净值1.0640元，C类基金份额4,675.92份。

## 6.2 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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		2,328,608.13	2,467,111.18
1. 利息收入		4,520,829.75	4,091,110.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,875.97	21,098.38

债券利息收入		4,352,332.16	4,030,816.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		162,621.62	39,195.74
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,005,774.08	-1,389,917.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-3,005,774.08	-1,389,917.36
资产支持证券投资 收益	6.4.7.14. 5	-	-
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	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	782,326.22	-369,449.90
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	31,226.24	135,367.45
<b>减：二、费用</b>		354,888.67	498,222.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	170,224.46	153,525.68
2. 托管费	6.4.10.2. 2	56,741.43	51,175.19
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	0.09	-
4. 交易费用	6.4.7.20	7,364.44	5,300.00
5. 利息支出		18,564.44	167,923.44

其中：卖出回购金融资产支出		18,564.44	167,923.44
6. 税金及附加		14,867.07	14,093.96
7. 其他费用	6.4.7.21	87,126.74	106,203.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,973,719.46	1,968,889.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,973,719.46	1,968,889.02

### 6.3 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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021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）	261,701,754.85	11,202,210.57	272,903,965.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,973,719.46	1,973,719.46
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）	-183,987,860.43	-8,190,419.79	-192,178,280.22
其中：1. 基金申购款	5,853,416.53	296,233.57	6,149,650.10
2. 基金赎回款	-189,841,276.96	-8,486,653.36	-198,327,930.32
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)	77,713,894.42	4,985,510.24	82,699,404.66
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	209,046,800.23	1,805,550.30	210,852,350.53
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	1,968,889.02	1,968,889.02
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)	-115,427,992.10	-1,151,525.08	-116,579,517.18
其中: 1. 基金申购款	22,423,891.32	537,136.31	22,961,027.63
2. 基金赎回 款	-137,851,883.42	-1,688,661.39	-139,540,544.81
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)	93,618,808.13	2,622,914.24	96,241,722.37

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:

张睿

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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”)。

根据本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2021年6月15日发布的《关于富安达富利纯债债券型证券投资基金增设C类基金份额及增加侧袋机制并修订基金合同和托管协议的公告》以及更新的《富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,自2021年6月15日起,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,分设A类、C类两类基金份额。其中,A类基金份额指在投资者申购时收取申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额;C类基金份额指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

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。

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2021年8月27日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期内所采用的会计政策、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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、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。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按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。

(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。

## 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	
	2021年06月30日	
活期存款	2,081,271.05	
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	2,081,271.05	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年06月30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	1,857,596.23	1,932,200.00	74,603.77
	银行间市场	66,707,782.47	66,672,000.00	-35,782.47
	合计	68,565,378.70	68,604,200.00	38,821.30
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	68,565,378.70	68,604,200.00	38,821.30	

## 6.4.7.3 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。

#### 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 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,300,215.45	-
合计	10,300,215.45	-

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	353.03
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	2,033,599.78
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	4,581.81
应收申购款利息	1,149.75
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.18
合计	2,039,684.55

注：其他为应收存出保证金利息。

**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 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	7,520.25
合计	7,520.25

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30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	24,795.19
预提费用-信息披露费	259,671.58
合计	284,466.77

**6.4.7.9 实收基金****6.4.7.9.1 富安达富利纯债债券A**

金额单位：人民币元

项目 (富安达富利纯债债券A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	261,701,754.85	261,701,754.85
本期申购	5,848,740.61	5,848,740.61
本期赎回(以“-”号填列)	-189,841,276.96	-189,841,276.96

本期末	77,709,218.50	77,709,218.50
-----	---------------	---------------

## 6.4.7.9.2 富安达富利纯债债券C

金额单位：人民币元

项目 (富安达富利纯债债券C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	4,675.92	4,675.92
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,675.92	4,675.92

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

## 6.4.7.10.1 富安达富利纯债债券A

单位：人民币元

项目 (富安达富利纯债债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,699,307.24	-2,497,096.67	11,202,210.57
本期利润	1,191,386.63	782,323.70	1,973,710.33
本期基金份额交易产生的变动数	-10,150,680.95	1,959,971.25	-8,190,709.70
其中：基金申购款	318,544.25	-22,600.59	295,943.66
基金赎回款	-10,469,225.20	1,982,571.84	-8,486,653.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,740,012.92	245,198.28	4,985,211.20

## 6.4.7.10.2 富安达富利纯债债券C

单位：人民币元

项目 (富安达富利纯债债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
--------------------	-------	-------	---------

C)			
上年度末	-	-	-
本期利润	6.61	2.52	9.13
本期基金份额交易产生的变动数	289.91	-	289.91
其中：基金申购款	289.91	-	289.91
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	296.52	2.52	299.04

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	5,455.36
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	68.30
其他	352.31
合计	5,875.97

#### 6.4.7.12 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。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30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	-3,005,774.08
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	-3,005,774.08

#### 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
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	362,200,205.47
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	353,733,451.34
减：应收利息总额	11,472,528.21
买卖债券差价收入	-3,005,774.08

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 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

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 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	782,326.22
——股票投资	-
——债券投资	782,326.22
——资产支持证券投资	-
——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	782,326.22

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	31,226.24
合计	31,226.24

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。

**6.4.7.20 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	11.94
银行间市场交易费用	7,352.50
合计	7,364.44

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,059.97
帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	87,126.74

#### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 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

2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，基金管理人股东江苏交通控股有限公司将其持有的本公司26%股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。

##### 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
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	基金管理人的股东、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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均未通过关联方的交易单元进行过股票交易。

###### 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均未通过关联方的交易单元进行过权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
南京证券	11,731,850.00	100.00%	-	-

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		债券回 购成交 总额的 比例		债券回 购成交 总额的 比例
南京证券	500,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.5 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均没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 2021年01月01日至202 1年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	170,224.46	153,525.68
其中：支付销售机构的客户维护费	29,109.03	3,549.96

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	56,741.43	51,175.19

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

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的销售服务费。

#### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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及上年度可比期间均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。

##### 6.4.10.4.2 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及上年度可比期间均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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

富安达富利纯债债券A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30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	9,999,200.00
报告期初持有的基金份额	34,572,750.66	19,974,259.86
报告期间申购/买入总份额	0.00	14,598,490.80
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	34,572,750.66	34,572,750.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	44.49%	36.93%

富安达富利纯债债券C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至 2020年06月30日
基金合同生效日（2019年07月23日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：1. 期间申购/买入总份额含转换入份额。

2. 基金管理人富安达基金在本年度投资本基金的交易委托直销中心办理，适用的费率按照基金招募说明书的规定执行。

3. 本基金自2021年6月15日起新增C类份额。

#### 6.4.10.5.2 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

富安达富利纯债债券A

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
富安达资管	39,311,876.24	50.59%	39,311,876.24	15.02%

富安达富利纯债债券C

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份

		额的比例		额的比例
富安达资管	0.00	0.00%	-	0.00%

注：本基金自2021年6月15日起新增C类份额。

#### 6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	2,081,271.05	5,455.36	385,160.00	1,460.19

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 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。

#### 6.4.11 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。

#### 6.4.12 期末（2021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

于2021年06月30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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2021年06月30日，本基金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债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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。

#### 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，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发行的证券，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。

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	20,131,000.00
A-1以下	-	-
未评级	-	19,996,000.00
合计	-	40,127,000.00

注：未评级债券为短期融资券和政策性金融债券。

#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 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。

#### 6.4.13.2.4 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,932,200.00	-
AAA以下	56,612,000.00	72,934,000.00
未评级	10,060,000.00	-
合计	68,604,200.00	72,934,000.00

注：未评级债券为政策性金融债券。

#### 6.4.13.2.5 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式的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 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。

#### 6.4.13.3 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、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

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

##### 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期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。

于2021年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### 6.4.13.4 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。

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：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年 06月30	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

日							
资产							
银行存款	2,081,271.05	-	-	-	-	-	2,081,271.05
存出保证金	450.38	-	-	-	-	-	450.38
交易性金融资产	4,060,000.00	24,394,000.00	26,259,000.00	13,891,200.00	-	-	68,604,200.00
买入返售金融资产	10,300,215.45	-	-	-	-	-	10,300,215.45
应收利息	-	-	-	-	-	2,039,684.55	2,039,684.55
应收申购款	-	-	-	-	-	13,783.73	13,783.73
资产总计	16,441,936.88	24,394,000.00	26,259,000.00	13,891,200.00	-	2,053,468.28	83,039,605.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,700.48	4,700.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,283.90	20,283.90
应付托管费	-	-	-	-	-	6,761.30	6,761.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.09	0.09
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,520.25	7,520.25
应交税费	-	-	-	-	-	16,467.71	16,467.71
其他负债	-	-	-	-	-	284,466.77	284,466.77
负债总计	-	-	-	-	-	340,200.50	340,200.50
利率敏感度缺口	16,441,936.88	24,394,000.00	26,259,000.00	13,891,200.00	-	1,713,267.78	82,699,404.66
上年度末 2020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	4,324,948.96	-	-	-	-	-	4,324,948.96
交易性金融资产	30,167,000.00	18,297,000.00	44,609,000.00	19,988,000.00	-	-	113,061,000.00
买入返	40,360,420.5	-	-	-	-	-	40,360,420.54

售金融资产	4						
应收利息	-	-	-	-	-	3,479,108.42	3,479,108.42
应收申购款	4,999,000.00	-	-	-	-	107,009,109.59	112,008,109.59
资产总计	79,851,369.50	18,297,000.00	44,609,000.00	19,988,000.00	-	110,488,218.01	273,233,587.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	10.14	10.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,325.17	21,325.17
应付托管费	-	-	-	-	-	7,108.41	7,108.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,444.03	11,444.03
应交税费	-	-	-	-	-	19,734.34	19,734.34
其他负债	-	-	-	-	-	270,000.00	270,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	329,622.09	329,622.09
利率敏感度缺口	79,851,369.50	18,297,000.00	44,609,000.00	19,988,000.00	-	110,158,595.92	272,903,965.42

#### 6.4.13.4.1.2 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	88,970.79	106,912.04
	2. 市场利率上升25个基点	-88,611.18	-106,490.60

#### 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

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2021年6月30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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

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2021年06月30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68,604,200.00元，无属于第一和第三层次的余额（2020年12月31日：属于第二层次的余额为113,061,000.00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2021年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2020年12月31日：无）。

##### 6.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

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。

## § 7 投资组合报告

### 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	68,604,200.00	82.62
	其中：债券	68,604,200.00	82.62
	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	10,300,215.45	12.40
	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	2,081,271.05	2.51
8	其他各项资产	2,053,918.66	2.47
9	合计	83,039,605.16	100.00

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 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。

### 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。

#### 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

本基金本报告期内未进行股票交易。

##### 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

本基金本报告期内未进行股票交易。

##### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

#### 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	10,060,000.00	12.16
	其中：政策性金融债	10,060,000.00	12.16
4	企业债券	58,544,200.00	70.79
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	68,604,200.00	82.96

#### 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	190207	19国开07	100,000	10,060,000.00	12.16

2	1480405	14广元建设债	300,000	6,108,000.00	7.39
3	1480519	14张掖债	300,000	6,099,000.00	7.37
4	1480461	14渝九龙债	300,000	6,090,000.00	7.36
5	1480572	14来宾工投债	300,000	6,054,000.00	7.32

#### 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。

#### 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投资。

#### 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	450.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,039,684.55

5	应收申购款	13,783.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,053,918.66

#### 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处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
富安 达富 利纯 债债 券A	231	336,403.54	73,941,995.92	95.1 5%	3,767,222.58	4.85%
富安 达富 利纯 债债 券C	1	4,675.92	0.00	0.00%	4,675.92	100.0 0%

合计	232	334,973.68	73,941,995.92	95.15%	3,771,898.50	4.85%
----	-----	------------	---------------	--------	--------------	-------

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	富安达富利纯债债券A	4,134.96	0.01%
	富安达富利纯债债券C	0.00	0.00%
	合计	4,134.96	0.01%

## 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	份额级别	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	富安达富利纯债债券A	0
	富安达富利纯债债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	富安达富利纯债债券A	0
	富安达富利纯债债券C	0
	合计	0

1、基金管理人高级管理人员、基金投资和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

单位：份

	富安达富利纯债债券A	富安达富利纯债债券C
--	------------	------------

基金合同生效日(2019年07月23日)基金份额总额	249,498,917.90	-
本报告期期初基金份额总额	261,701,754.85	-
本报告期基金总申购份额	5,848,740.61	4,675.92
减:本报告期基金总赎回份额	189,841,276.96	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	77,709,218.50	4,675.92

## § 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,本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内,本基金托管人交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 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。

### 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为毕马威华振会计师事务所(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,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。

### 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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华龙	2	-	-	-	-	-

证券						
华西 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
南京 证券	2	-	-	-	-	-
上海 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	3	-	-	-	-	-

注：

1. 为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

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

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

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

(四) 能根据公司特定要求, 提供专门研究报告;

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

## 2. 券商专用交易单元选择程序:

(一) 券商席位由投资研究部业务人员推荐, 经投资研究部、固定收益部、多资产投资部会议讨论, 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) 投资研究部、固定收益部、多资产投资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, (011542) 华安证券和 (48977) 华安证券为本基金本期新增的交易单元。

## 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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证	-	-	-	-	-	-	-	-

券									
华创证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证 券	11,731,85 0.00	100.0 0%	500,00 0.00	100.0 0%	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

本基金本报告期内未通过交易单元进行权证、基金交易。

### 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关于旗下基金参加国金证券费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-01-16
2	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	规定媒介	2021-01-21
3	富安达富利纯债债券型证券投资基金2020年第四季度报告	规定媒介	2021-01-21
4	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参加农业银行费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-01-29
5	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-02-06
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	规定媒介	2021-02-24
7	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京植信基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-03-01

8	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-03
9	富安达基金管理有限公司关于暂停通过建设银行直联办理网上交易部分业务的通知	规定媒介	2021-03-05
10	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加和耕传承为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-03-10
11	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-11
12	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-03-24
13	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2021-03-29
14	富安达富利纯债债券型证券投资基金2020年年度报告	规定媒介	2021-03-29
15	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-04-08
16	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	规定媒介	2021-04-21
17	富安达富利纯债债券型证券投资基金2021年第1季度报告	规定媒介	2021-04-21
18	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加财咨道信息技术有限公司为销售机构并与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-26
19	富安达基金管理有限公司关于参加部分基金销售机构费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-04-28

20	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-05-07
21	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加泛华普益为销售机构的公告	规定媒介	2021-05-18
22	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加万得基金为销售机构的公告	规定媒介	2021-05-26
23	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-04
24	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京钱景基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-07
25	富安达基金管理有限公司关于参加上海万得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-07
26	富安达富利纯债债券型证券投资基金基金合同	规定媒介	2021-06-15
27	富安达富利纯债债券型证券投资基金托管协议	规定媒介	2021-06-15
28	富安达基金管理有限公司关于富安达富利纯债债券型证券投资基金增设 C 类基金份额及增加侧袋机制并修订基金合同和托管协议的公告	规定媒介	2021-06-15
29	富安达富利纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-06-16

30	富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书(更新)(二零二一年第一号)	规定媒介	2021-06-16
31	富安达富利纯债债券型证券投资基金招募说明书更新提示性公告	规定媒介	2021-06-16
32	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-06-16
33	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2021-06-18
34	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海爱建基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2021-06-25

## § 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

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	20210202-20210630	34,572,750.66	0.00	0.00	34,572,750.66	44.49%
	2	20210202-20210630	39,311,876.24	0.00	0.00	39,311,876.24	50.59%
个人	1	20210104-20210201	95,913,101.86	0.00	95,913,101.86	0.00	0.00%
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。							

### 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。

## 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

二〇二一年八月三十一日