

---

# 富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金

## 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	7
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	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§6 中期财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§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.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	富安达新动力混合
基金主代码	001659
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月07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	12,084,471.03份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过股票与债券等资产的合理配置，深入研究并积极投资于以科技进步、产业创新和转型升级等经济发展新动力驱动的高速成长企业，充分把握新经济周期下科技进步、产业创新和转型升级所带来的投资机会，在有效控制风险的前提下，力争为投资者带来长期稳定的超额收益。
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。一般情况下，本基金将大部分基金资产投资于以科技进步、产业创新和转型升级等经济发展新动力驱动的上市公司所发行的股票等证券，当证券市场系统性风险加大时，本基金将对相关证券资产的配置比例做出适时调整。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%

风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
--------	---

### 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号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路18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)
本期已实现收益	7,398,937.37
本期利润	1,687,867.76
加权平均基金份额本期利润	0.0917
本期加权平均净值利润率	4.59%
本期基金份额净值增长率	4.90%
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	13,269,620.61
期末可供分配基金份额利润	1.0981
期末基金资产净值	25,354,091.64
期末基金份额净值	2.0981
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	109.81%

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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	3.91%	1.24%	2.48%	0.75%	1.43%	0.49%
过去三个月	13.06%	1.18%	9.48%	0.74%	3.58%	0.44%
过去六个月	4.90%	1.70%	5.68%	0.97%	-0.78%	0.73%
过去一年	18.68%	1.64%	21.81%	0.96%	-3.13%	0.68%
过去三年	76.10%	1.49%	47.80%	0.95%	28.30%	0.54%
自基金合同生效起至今	109.81%	1.30%	42.39%	0.85%	67.42%	0.45%

注：

1. 本基金业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%，
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：

$$\text{Return}_t = 60\% \times [\text{中证新兴产业指数}_t \div \text{中证新兴产业指数}_{(t-1)} - 1] + 40\% \times [\text{中债总指数}_t \div \text{中债总指数}_{(t-1)} - 1]$$

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

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

富安达新动力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

(2016年12月07日-2021年06月30日)



## § 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、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、富安达长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		
朱义	本基金的基金经理、公司投资研究部总监助理	2018-11-30	-	18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、投资研究部总监助理兼基

					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、富安达行业轮动灵活配置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的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：

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、《富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年仍是新冠疫情后的经济修复期，国内经济已基本恢复至新冠疫情前水平，但增速有所放缓。社融增速在6月出现止跌企稳迹象，货币政策边际重新再趋宽松。上半年证券市场整体波动加大，各指数表现差异较大，创业板指、科创板指涨幅远好于沪深300和上证综指。在碳中和、国产替代以及缺芯等事件影响下，新能源、半导体、医疗服务等高增长行业表现优异，而这些上市公司大部分集中在创业板。相比之下，部分传统中游制造企业受下游需求偏弱、未能转嫁原材料成本的影响而业绩受损。本基金在上半年保持了较高的持仓，配置在新能源、电子和医疗服务的仓位对净值有正贡献，而部分消费股拖累了净值表现。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达新动力混合基金份额净值为2.0981元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.90%，同期业绩比较基准收益率为5.68%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济修复增速可能放缓。7月政治局会议指出要保持流动性合理充裕，通过财政政策推动今年底明年初形成实物工作量，因而经济总体仍有韧性。产业政策方向上支持新能源汽车，加快解决“卡脖子”难题。从国家政策和行业景气度出发，中长期依然看好新能源、国产替代、高端制造、医疗服务、内需消费等优秀赛道头部公司的投资机会。我们仍将聚焦于相关领域个股挖掘，争取为基金持有人获取良好的投资回报。

#### 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

本报告期内，本基金存在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，基金托管人在富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，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新动力灵活配置混合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新动力灵活配置混合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：富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金

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	3,192,380.86	4,054,119.71
结算备付金		261,543.64	80,236.28
存出保证金		32,563.70	20,470.69
交易性金融资产	6.4.7.2	22,620,479.53	41,528,572.78
其中：股票投资		22,620,479.53	41,528,572.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收证券清算款		530,623.25	275,684.84
应收利息	6.4.7.5	1,287.59	828.00
应收股利		-	-
应收申购款		1,507.74	1,992,305.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,640,386.31	47,952,217.95
<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		195,585.81	631,951.36
应付赎回款		741,559.16	2,203,659.04
应付管理人报酬		37,564.74	53,822.09
应付托管费		6,260.77	8,970.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	120,693.87	51,152.78
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	184,630.32	194,072.31
负债合计		1,286,294.67	3,143,627.93
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	12,084,471.03	22,404,716.27
未分配利润	6.4.7.10	13,269,620.61	22,403,873.75
所有者权益合计		25,354,091.64	44,808,590.02
负债和所有者权益总计		26,640,386.31	47,952,217.95

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额净值2.0981元，基金份额总额12,084,471.03份。

## 6.2 利润表

会计主体：富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金

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	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
一、收入		2,453,708.77	8,693,641.21

1. 利息收入		22,354.42	20,819.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,354.42	20,819.86
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,095,523.94	5,558,488.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,978,125.53	5,294,866.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.	-	-
收益	2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	117,398.41	263,622.03
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,711,069.61	3,102,712.85
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	46,900.02	11,620.06
<b>减：二、费用</b>		765,841.01	573,844.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	275,773.45	336,615.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,962.24	56,102.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	368,882.52	105,901.54

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	75, 222. 80	75, 225. 01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 687, 867. 76	8, 119, 796. 56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 687, 867. 76	8, 119, 796. 56

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金

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）	22, 404, 716. 27	22, 403, 873. 75	44, 808, 590. 02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1, 687, 867. 76	1, 687, 867. 76
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）	-10, 320, 245. 24	-10, 822, 120. 90	-21, 142, 366. 14
其中：1. 基金申购款	2, 008, 994. 69	2, 008, 707. 49	4, 017, 702. 18
2. 基金赎回款	-12, 329, 239. 93	-12, 830, 828. 39	-25, 160, 068. 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)	12,084,471.03	13,269,620.61	25,354,091.64
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)	31,036,764.25	14,776,854.06	45,813,618.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,119,796.56	8,119,796.56
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)	-8,237,612.38	-5,391,639.73	-13,629,252.11
其中: 1. 基金申购款	12,952,946.93	6,986,700.12	19,939,647.05
2. 基金赎回款	-21,190,559.31	-12,378,339.85	-33,568,899.16
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)	22,799,151.87	17,505,010.89	40,304,162.76

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

富安达新动力灵活配置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[2015]1475号《关于准予富安达新动力灵活配置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《富安达新动力灵活配置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350,703,184.13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1610号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为350,747,173.59份基金份额,其中认购资金利息折合43,989.46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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达新动力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、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、资产支持证券、中小企业私募债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货以及经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%,其中投资于新动力主题相关的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,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:中证新兴产业指数收益率 $\times$ 60%+中债总指数收益率 $\times$ 40%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于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<年度报告和中期报告>》、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》、《富安达新动力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6.4.4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2021年6月30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备案解决方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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	3,192,380.86
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	3,192,380.86

##### 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		20,602,682.56	22,620,479.53	2,017,796.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		20,602,682.56	22,620,479.53	2,017,796.97

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,167.65
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	105.93

应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.78
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	13.23
合计	1,287.59

#### 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	120,693.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	120,693.87

#### 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	82.35
应付证券出借违约金	-
预提费用	184,547.97
合计	184,630.32

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,404,716.27	22,404,716.27
本期申购	2,008,994.69	2,008,994.69
本期赎回（以“-”号填列）	-12,329,239.93	-12,329,239.93
本期末	12,084,471.03	12,084,471.03

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,695,069.27	4,708,804.48	22,403,873.75
本期利润	7,398,937.37	-5,711,069.61	1,687,867.76
本期基金份额交易产生的变动数	-10,441,285.22	-380,835.68	-10,822,120.90
其中：基金申购款	2,095,176.95	-86,469.46	2,008,707.49
基金赎回款	-12,536,462.17	-294,366.22	-12,830,828.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,652,721.42	-1,383,100.81	13,269,620.61

#### 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	20,865.71
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	1,293.23	
其他	195.48	
合计	22,354.42	

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	136,093,518.13
减：卖出股票成本总额	128,115,392.60
买卖股票差价收入	7,978,125.53

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 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。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	117,398.41
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	117,398.41

**6.4.7.17 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	-5,711,069.61
——股票投资	-5,711,069.61
——债券投资	-
——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	-5,711,069.61

#### 6.4.7.18 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	44,112.27
转换费收入	2,787.75
合计	46,900.02

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。

#### 6.4.7.19 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	368,882.52
银行间市场交易费用	-
合计	368,882.52

#### 6.4.7.20 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	29,752.78
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,674.83
账户维护费	18,000.00
合计	75,222.80

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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（“南京证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
--------------------	-----------------

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

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 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
南京证券	51,240,497.53	20.43%	0.00	0.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
南京证券	47,720.30	22.67%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	-	-	-	-

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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管理费	275,773.45	336,615.54
其中：支付销售机构的客户维护费	37,739.00	50,148.91

注：

1. 支付基金管理人富安达基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。
2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	45,962.24	56,102.56

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0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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。

##### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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。

#### 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

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（2016年12月07日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	6,567,056.35	6,567,056.35
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	6,567,056.35	6,567,056.35
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	54.34%	28.80%

#### 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

本报告期末及上年度期末均无除基金管理人之外其他关联方投资本基金的情况。

#### 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	3,192,380.86	20,865.71	3,022,941.89	20,164.56

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未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	因刊登重要事项公告	56.35	2021-07-01	59.49	3,200	141,248.00	180,320.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 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

本基金为混合型证券投资基金，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金通过股票与债券等资产的合理配置，深入研究并积极投资于以科技进步、产业创新和转型升级等经济发展新动力驱动的高速成长企业，充分把握新经济周期下科技进步、产业创新和转型升级所带来的投资机会，在有效控制风险的前提下，力争为投资者带来长期稳定的超额收益。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管

理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、董事。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2021年6月30日，本基金无债券投资(2020年12月31日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于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。

#### 6.4.13.3.1 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》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上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未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。于2021年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,192,380.86	-	-	-	3,192,380.86
结算备付金	261,543.64	-	-	-	261,543.64
存出保证金	32,563.70	-	-	-	32,563.70
交易性金融资产	-	-	-	22,620,479.53	22,620,479.53
应收证券清算款	-	-	-	530,623.25	530,623.25
应收利息	-	-	-	1,287.59	1,287.59
应收申购款	-	-	-	1,507.74	1,507.74
资产总计	3,486,488.20	-	-	23,153,898.11	26,640,386.31

计					
负债					
应付证券清算款	-	-	-	195,585.81	195,585.81
应付赎回款	-	-	-	741,559.16	741,559.16
应付管理人报酬	-	-	-	37,564.74	37,564.74
应付托管费	-	-	-	6,260.77	6,260.77
应付交易费用	-	-	-	120,693.87	120,693.87
其他负债	-	-	-	184,630.32	184,630.32
负债总计	-	-	-	1,286,294.67	1,286,294.67
利率敏感度缺口	3,486,488.20	-	-	21,867,603.44	25,354,091.64
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,054,119.71	-	-	-	4,054,119.71
结算备付金	80,236.28	-	-	-	80,236.28
存出保证金	20,470.69	-	-	-	20,470.69
交易性金融资产	-	-	-	41,528,572.78	41,528,572.78
应收证券清算款	-	-	-	275,684.84	275,684.84
应收利息	-	-	-	828.00	828.00
应收申购款	-	-	-	1,992,305.65	1,992,305.65
资产总计	4,154,826.68	-	-	43,797,391.27	47,952,217.95
负债					

应付证券清算款	-	-	-	631,951.36	631,951.36
应付赎回款	-	-	-	2,203,659.04	2,203,659.04
应付管理人报酬	-	-	-	53,822.09	53,822.09
应付托管费	-	-	-	8,970.35	8,970.35
应付交易费用	-	-	-	51,152.78	51,152.78
其他负债	-	-	-	194,072.31	194,072.31
负债总计	-	-	-	3,143,627.93	3,143,627.93
利率敏感度缺口	4,154,826.68	-	-	40,653,763.34	44,808,590.02

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2020年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合联储模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的

配置比例。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	22,620,479.53	89.22	41,528,572.78	92.68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,620,479.53	89.22	41,528,572.78	92.68

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证新兴产业指数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. 中证新兴产业指数上升5%	1, 273, 080. 59	2, 444, 371. 79
	2. 中证新兴产业指数下降5%	-1, 273, 080. 59	-2, 444, 371. 79

注：本基金本期末其他价格风险的敏感性计算中所使用的  $\beta$  系数为股票组合的  $\beta$  系数，即资产负债表日投资组合内各个股票的  $\beta$  加权平均。

#### 6.4.14 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2021年6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一层次的余额为22,620,479.53元，无属于第二或第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次41,521,981.42元，第二层次6,591.36元，无第三层次)。

##### (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2021年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020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。

## § 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	22,620,479.53	84.91
	其中：股票	22,620,479.53	84.91
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	-	-
	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	3,453,924.50	12.96
8	其他各项资产	565,982.28	2.12
9	合计	26,640,386.31	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	16,882,037.10	66.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	225,449.00	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,649,520.60	10.45
J	金融业	1,026,366.45	4.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	240,080.00	0.95
M	科学研究和技术服务业	208,728.38	0.82
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	734,540.00	2.90
R	文化、体育和娱乐业	653,758.00	2.58
S	综合	-	-
	合计	22,620,479.53	89.22

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	2,400	1,283,520.00	5.06
2	600519	贵州茅台	600	1,234,020.00	4.87
3	300014	亿纬锂能	10,100	1,049,693.00	4.14
4	300347	泰格医药	3,800	734,540.00	2.90

5	688012	中微公司	4,089	678,446.88	2.68
6	002074	国轩高科	15,400	670,824.00	2.65
7	300413	芒果超媒	9,530	653,758.00	2.58
8	601012	隆基股份	6,660	591,674.40	2.33
9	603986	兆易创新	3,000	563,700.00	2.22
10	300896	爱美客	700	552,216.00	2.18
11	688580	伟思医疗	2,878	482,065.00	1.90
12	688198	佰仁医疗	1,919	437,532.00	1.73
13	300253	卫宁健康	26,800	436,036.00	1.72
14	300171	东富龙	10,400	422,760.00	1.67
15	002624	完美世界	17,600	420,816.00	1.66
16	603893	瑞芯微	3,000	418,380.00	1.65
17	688208	道通科技	4,503	391,715.97	1.54
18	688536	思瑞浦	705	388,455.00	1.53
19	002415	海康威视	5,500	354,750.00	1.40
20	300790	宇瞳光学	10,400	352,872.00	1.39
21	600699	均胜电子	13,800	352,176.00	1.39
22	600703	三安光电	10,900	349,345.00	1.38
23	300496	中科创达	2,200	345,532.00	1.36
24	600036	招商银行	6,100	330,559.00	1.30
25	300363	博腾股份	3,900	328,068.00	1.29
26	002410	广联达	4,700	320,540.00	1.26
27	002706	良信股份	14,200	320,068.00	1.26
28	300751	迈为股份	700	318,290.00	1.26
29	002475	立讯精密	6,900	317,400.00	1.25
30	601318	中国平安	4,800	308,544.00	1.22
31	688981	中芯国际	4,701	290,615.82	1.15
32	600346	恒力石化	10,900	286,016.00	1.13
33	603712	七一二	7,800	281,580.00	1.11
34	601601	中国太保	9,700	281,009.00	1.11
35	603345	安井食品	1,100	279,422.00	1.10

36	000932	华菱钢铁	40,300	265,980.00	1.05
37	600882	妙可蓝多	3,700	258,260.00	1.02
38	002371	北方华创	900	249,642.00	0.98
39	601888	中国中免	800	240,080.00	0.95
40	000963	华东医药	4,900	225,449.00	0.89
41	603501	韦尔股份	700	225,400.00	0.89
42	300782	卓胜微	400	215,000.00	0.85
43	300113	顺网科技	16,100	208,334.00	0.82
44	300760	迈瑞医疗	424	203,541.20	0.80
45	002459	晶澳科技	4,100	200,900.00	0.79
46	002405	四维图新	12,600	185,220.00	0.73
47	600460	士兰微	3,200	180,320.00	0.71
48	000938	紫光股份	7,800	170,664.00	0.67
49	002049	紫光国微	1,100	169,609.00	0.67
50	002273	水晶光电	11,500	168,935.00	0.67
51	601689	拓普集团	4,300	160,949.00	0.63
52	601633	长城汽车	3,600	156,924.00	0.62
53	300012	华测检测	4,781	152,418.28	0.60
54	000651	格力电器	2,900	151,090.00	0.60
55	002555	三七互娱	6,100	146,522.00	0.58
56	300207	欣旺达	4,400	143,264.00	0.57
57	600893	航发动力	2,600	138,294.00	0.55
58	002460	赣锋锂业	1,100	133,199.00	0.53
59	601877	正泰电器	3,900	130,182.00	0.51
60	300454	深信服	500	129,740.00	0.51
61	300642	透景生命	1,500	128,715.00	0.51
62	002050	三花智控	4,800	115,104.00	0.45
63	688396	华润微	1,028	93,568.56	0.37
64	688617	惠泰医疗	245	93,342.55	0.37
65	601166	兴业银行	4,500	92,475.00	0.36
66	603678	火炬电子	1,300	87,750.00	0.35

67	688016	心脉医疗	193	87,739.73	0.35
68	600282	南钢股份	23,400	83,304.00	0.33
69	300726	宏达电子	1,100	77,539.00	0.31
70	600406	国电南瑞	2,940	68,325.60	0.27
71	600171	上海贝岭	2,000	60,860.00	0.24
72	003035	南网能源	5,665	56,310.10	0.22
73	000568	泸州老窖	199	46,952.06	0.19
74	603658	安图生物	520	39,400.40	0.16
75	002709	天赐材料	310	33,039.80	0.13
76	601528	瑞丰银行	885	13,779.45	0.05
77	001208	华菱线缆	701	5,418.73	0.02

#### 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

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	300014	亿纬锂能	4,806,508.00	10.73
2	601012	隆基股份	3,736,315.85	8.34
3	300750	宁德时代	3,659,986.00	8.17
4	300413	芒果超媒	2,805,843.00	6.26
5	002459	晶澳科技	2,799,920.00	6.25
6	300122	智飞生物	2,672,581.00	5.96
7	002410	广联达	2,550,420.28	5.69
8	000651	格力电器	2,341,947.00	5.23
9	601689	拓普集团	1,923,582.00	4.29
10	300253	卫宁健康	1,897,795.79	4.24
11	688396	华润微	1,836,322.80	4.10
12	688198	佰仁医疗	1,793,233.23	4.00
13	600882	妙可蓝多	1,775,968.45	3.96
14	002555	三七互娱	1,775,800.00	3.96

15	603501	韦尔股份	1,645,968.00	3.67
16	300073	当升科技	1,622,549.00	3.62
17	600703	三安光电	1,424,298.00	3.18
18	002415	海康威视	1,387,896.00	3.10
19	002049	紫光国微	1,350,916.68	3.01
20	300558	贝达药业	1,273,591.00	2.84
21	300896	爱美客	1,239,811.89	2.77
22	300595	欧普康视	1,217,922.00	2.72
23	300327	中颖电子	1,214,036.00	2.71
24	002475	立讯精密	1,209,407.00	2.70
25	688208	道通科技	1,207,977.22	2.70
26	300113	顺网科技	1,197,535.68	2.67
27	002241	歌尔股份	1,186,813.00	2.65
28	002371	北方华创	1,126,072.00	2.51
29	002920	德赛西威	1,124,851.00	2.51
30	002373	千方科技	1,122,070.00	2.50
31	300347	泰格医药	1,107,155.00	2.47
32	601601	中国太保	1,057,278.00	2.36
33	002709	天赐材料	1,045,298.00	2.33
34	000858	五 粮 液	1,020,970.00	2.28
35	688363	华熙生物	1,016,119.56	2.27
36	300037	新宙邦	1,010,404.00	2.25
37	601877	正泰电器	1,000,510.00	2.23
38	300454	深信服	987,584.00	2.20
39	688008	澜起科技	974,197.58	2.17
40	300207	欣旺达	941,030.00	2.10
41	002912	中新赛克	915,946.00	2.04
42	300274	阳光电源	912,253.00	2.04
43	600282	南钢股份	903,040.00	2.02

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

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	300014	亿纬锂能	6,746,573.48	15.06
2	300750	宁德时代	5,227,610.00	11.67
3	601012	隆基股份	4,709,817.00	10.51
4	300413	芒果超媒	3,402,364.80	7.59
5	002459	晶澳科技	3,306,847.48	7.38
6	300274	阳光电源	3,150,856.00	7.03
7	300122	智飞生物	2,791,473.00	6.23
8	000651	格力电器	2,410,834.00	5.38
9	300454	深信服	2,352,523.80	5.25
10	300073	当升科技	2,037,068.00	4.55
11	600438	通威股份	2,027,798.00	4.53
12	002410	广联达	1,983,095.00	4.43
13	688008	澜起科技	1,889,689.94	4.22
14	603259	药明康德	1,858,681.56	4.15
15	000858	五粮液	1,724,579.00	3.85
16	300253	卫宁健康	1,703,799.70	3.80
17	601877	正泰电器	1,700,667.00	3.80
18	688396	华润微	1,686,064.98	3.76
19	600882	妙可蓝多	1,520,413.00	3.39
20	300124	汇川技术	1,506,961.00	3.36
21	002241	歌尔股份	1,477,806.00	3.30
22	688198	佰仁医疗	1,477,402.29	3.30
23	002555	三七互娱	1,463,824.11	3.27
24	601689	拓普集团	1,451,359.00	3.24
25	603501	韦尔股份	1,437,504.88	3.21
26	300595	欧普康视	1,427,660.40	3.19

27	002371	北方华创	1,424,285.00	3.18
28	002415	海康威视	1,382,708.00	3.09
29	603444	吉比特	1,341,381.24	2.99
30	688016	心脉医疗	1,316,032.82	2.94
31	002049	紫光国微	1,289,892.00	2.88
32	603605	珀莱雅	1,278,515.00	2.85
33	300327	中颖电子	1,275,604.96	2.85
34	600703	三安光电	1,260,319.00	2.81
35	300558	贝达药业	1,248,744.00	2.79
36	000568	泸州老窖	1,234,160.96	2.75
37	002709	天赐材料	1,214,130.00	2.71
38	600276	恒瑞医药	1,206,410.00	2.69
39	300113	顺网科技	1,203,820.00	2.69
40	002460	赣锋锂业	1,172,034.50	2.62
41	601318	中国平安	1,155,797.00	2.58
42	002920	德赛西威	1,152,550.32	2.57
43	002594	比亚迪	1,151,177.00	2.57
44	300896	爱美客	1,120,361.00	2.50
45	002739	万达电影	1,092,808.00	2.44
46	300012	华测检测	1,040,795.00	2.32
47	002373	千方科技	1,025,813.00	2.29
48	002624	完美世界	1,011,295.75	2.26
49	300037	新宙邦	999,788.00	2.23
50	600089	特变电工	988,459.00	2.21
51	688363	华熙生物	948,752.59	2.12
52	002475	立讯精密	936,412.00	2.09
53	300751	迈为股份	925,617.00	2.07
54	002050	三花智控	913,620.86	2.04

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	114,918,368.96
卖出股票收入（成交）总额	136,093,518.13

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,563.70
2	应收证券清算款	530,623.25
3	应收股利	-
4	应收利息	1,287.59
5	应收申购款	1,507.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	565,982.28

## 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

## § 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

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
585	20,657.22	6,567,056.35	54.34%	5,517,414.68	45.66%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	35,944.43	0.30%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：

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0~10万份（含）。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年12月07日)基金份额总额	350,747,173.59
本报告期期初基金份额总额	22,404,716.27
本报告期基金总申购份额	2,008,994.69
减：本报告期基金总赎回份额	12,329,239.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,084,471.03

## § 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 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	-	-	-	-	-
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	111,870,220.96	44.61%	81,810.89	38.86%	-
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	3,106,731.42	1.24%	2,271.96	1.08%	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中泰 证券	1	-	-	-	-	-
长江 证券	2	-	-	-	-	-
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	13,165,777.00	5.25%	12,261.43	5.82%	-
光大 证券	2	18,019,758.81	7.19%	16,781.90	7.97%	-
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 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
南京 证券	2	51,240,497.53	20.43%	47,720.30	22.67%	-
上海 证券	2	48,266,059.91	19.25%	44,950.11	21.35%	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	5,097,925.11	2.03%	4,747.66	2.25%	-
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

本基金本报告期内未通过交易单元进行债券交易、债券回购交易、权证交易、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部分公募基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议有关条款的公告	规定媒介	2021-01-15
2	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同	规定媒介	2021-01-15
3	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议	规定媒介	2021-01-15
4	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二一年第一号）	规定媒介	2021-01-15
5	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2021-01-15
6	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
7	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
8	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	规定媒介	2021-01-21
9	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
10	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
11	富安达基金管理有限公司关	规定媒介	2021-02-24

	于系统升级暂停服务的公告		
12	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
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	规定媒介	2021-03-29
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	2021-04-08
21	富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金2021年第1季度报告	规定媒介	2021-04-21
22	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

23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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
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	2021-06-18
33	富安达基金管理有限公司关	规定媒介	2021-06-25

	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		
--	---------------------------------------	--	--

## § 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	20210104-20210630	6,567,056.35	0.00	0.00	6,567,056.35	54.34%
	2	20210104-20210623	4,530,831.35	0.00	4,530,831.35	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% 的投资者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新动力灵活配置混合型证券投资基金设立的文件：《富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；《富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；《富安达新动力灵活配置混合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