富安达增强收益债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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：2019年03月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富安达增强收益债券	
基金主代码	710301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年07月25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	46,999,125.31份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
下属分级基金的交易代码	710301	710302
报告期末下属分级基金的份额总额	19,302,937.51份	27,696,187.80份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在控制风险与保持资产流动性的基础上，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资回报。
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，综合比较大类资产的收益及风险情况，确定债券、股票、现金等大类资产配置比例。 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。本基金的股票类资产作为整体基金投资组合管理的辅助工具，为投资人提供适度参与股票市场、获取超额收益的机会。
业绩比较基准	中债总指数收益率×90%＋沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金，属于具有中高风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	沈伟青	陆志俊
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999（免长途）021-61870666	95559
传真		021-61870888	021-62701216

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年	
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
本期已实现收益	-1,208,921.60	-1,767,052.00	-1,141,308.01	-1,488,180.86	-1,941,415.40	-4,672,163.55
本期利润	-2,535,590.69	-3,724,193.03	-949,993.13	-1,298,887.46	-3,382,887.27	-7,459,760.53
加权平均基金份额本期利润	-0.1343	-0.1370	-0.0484	-0.0531	-0.2438	-0.2845
本期基金份额净值增长率	-12.00%	-12.35%	-4.17%	-4.57%	-19.69%	-20.02%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0263	-0.0521	0.1065	0.0814	0.1547	0.1332
期末基金资产净值	18,795,219.11	26,252,807.48	21,122,698.85	26,196,590.04	16,838,846.64	32,443,448.48
期末基金份额净值	0.9737	0.9479	1.1065	1.0814	1.1547	1.1332

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

富安达增强收益债券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
过去三个月	-4.94%	0.83%	1.80%	0.16%	-6.74%	0.67%
过去六个月	-6.28%	0.82%	2.56%	0.15%	-8.84%	0.67%
过去一年	-12.00%	0.96%	5.73%	0.15%	-17.73%	0.81%
过去三年	-32.28%	0.88%	6.91%	0.15%	-39.19%	0.73%
过去五年	-1.19%	1.09%	33.34%	0.19%	-34.53%	0.90%
自基金合同生效起至今	-0.72%	0.98%	30.69%	0.18%	-31.41%	0.80%

富安达增强收益债券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
过去三个月	-5.03%	0.83%	1.80%	0.16%	-6.83%	0.67%
过去六个月	-6.47%	0.82%	2.56%	0.15%	-9.03%	0.67%
过去一年	-12.35%	0.96%	5.73%	0.15%	-18.08%	0.81%
过去三年	-33.10%	0.88%	6.91%	0.15%	-40.01%	0.73%
过去五年	-3.21%	1.09%	33.34%	0.19%	-36.55%	0.90%
自基金合同生效起至今	-3.35%	0.98%	30.69%	0.18%	-34.04%	0.80%

1、本基金业绩比较基准为：10%×沪深300指数＋90%×中债总财富总指数，

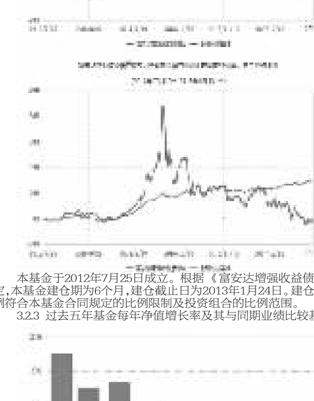
2、本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$Return_t = 10\% \times [沪深300指数_t / 沪深300指数_{(t-1)} - 1] + 90\% \times [中债总财富总指数_t / 中债总财富总指数_{(t-1)} - 1]$

$Benchmark_t = (1 + Return_t) \times Benchmark_{(t-1)}$

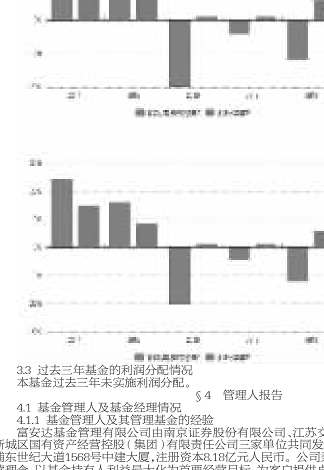
其中，t＝1,2,3,…T，T 表示时间截至日。

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



本基金于2012年7月25日成立。根据《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2013年1月24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 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2018年12月31日，公司共管理10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、富安达长盈保本混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李飞	本基金的基金经理公司固定收益部副总监（主持工作）、投资管理部总监助理（主持工作）	2013-07-04	–	14年	博士。历任上海技术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）。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《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、《富安达增强收益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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年的中国权益市场先扬后抑，实体经济减速、金融去杠杆加强监管、中美贸易摩擦、美联储连续加息、民企融资难且贵和上市公司股东股权质押爆仓等各类事件叠加爆发恶化，造成风险资产极度低迷，风险偏好极度压缩，上证综指全年下跌18%，行业指数无一上涨。债市走势略微分化，利率债表现最好，信用债和转债表现较差。央行引导资金面合理下行，银行间狭义流动性充沛，在通缩预期和避险需求的推动下，利率债收益率大幅下行，10年国债从年初3.98%下探至年末的3.30%，同期1年期的国开债则下行了170bp至3.0%；全年债券违约净额和只数分别达到1191亿元和114家，违约率接近1%，均创历史之最，信用债全年发行受阻，三季度后国家一系列疏导信用的政策的扶持下，年末一级发行有所缓解，但估值的信用利差（特别是中低资质和长久期）依旧在历史水平之上，融资不畅依旧存在，信用创造机制仍需进一步疏通和拓宽。年末中美收益率短端出现了倒挂，银行间跨年资金需求旺盛，预示未来短端下行空间有限。本基金对中国经济和资本市场秉持观有为态势，因此持有较多大盘转债和信用债，操作上也未能因势利导而相继抉择，因此全年表现并不尽如人意。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达增强收益债券A基金份额净值为0.9737元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.00%，同期业绩比较基准收益率为5.73%；截至报告期末富安达增强收益债券C基金份额净值为0.9479元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.35%，同期业绩比较基准收益率为5.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计2019年，中国经济依旧处于三期叠加的下行期，传统拉动经济的三驾马车歇火，外部性矛盾重重，周期性和结构性的约束因素造成经济政策腾挪空间有限，只能从体制性改革中寻找政策实施空间。股票市场目前已经三底重合（政策底、估值底和预期底），未来预计经济底或将在上半年显现，市场等待政府减税、中美贸易和解和进一步经济改革的信号，任何事件一旦发生，预计市场随时会有信心恢复性反弹，外资青睐的蓝筹白马仍将是配置的重点。展望债券市场，我们秉承乐观有为的积极策略。主要基于我们认为：1、经济仍处于下行期。预计国内外总需求都将惯性下行，通缩风险显现，在保证经济增长运行在合理区间的政策目标下，流动性将维持在合理充裕水平，宏观经济政策将稳中求变，基本面上利好债券资产；2、美国进入加息中后程。人民币汇率有望稳定，中美收益率倒挂现象可能缓解，或将打开央行进一步降准，甚至非对称下调贷款基准利率等价格型货币政策的实施空间，我国债市下行的外部制约因素将得到有效放松；3、国内进入稳杠杆阶段。2018年下半年民企流动性纾困和加大中小微贷款的投放一系列政策的落实，预计将稳定民间有效投资，信用创造渠道有望得以拓宽，目前高企的信用利差有望显著下行。2019年利率债在基本面、政策面和流动性的推动下预计将维持向好态势，但更多的投资机会或将来源于2018年表现相对一般的信用债的净价收益和目前处于市场底部的可转债的配置收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，研究发展部、投资管理部、监察稽核部和基金事务部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、估值模型、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期未进行收益分配。

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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018年度，基金托管人在富安达增强收益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

2018年度，富安达基金管理有限公司在富安达增强收益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的真实、准确和完整发表意见

2018年度，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增强收益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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了富安达增强收益债券型证券投资基金的财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表，2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。注册会计师陈熹、都晓燕于2018年3月28日签字出具了普华永道中天审字(2019)第20949号标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富安达增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	75,087.68	76,293.66
结算备付金	1,666,680.35	1,702,879.92
存出保证金	13,445.59	33,293.34
交易性金融资产	59,924,516.00	60,051,866.47
其中：股票投资	8,604,946.00	9,578,809.00
基金投资	–	–
债券投资	51,319,570.00	50,473,057.47
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	341,046.70	313,828.71
应收利息	295,583.86	293,078.15
应收股利	–	–
应收申购款	800.19	24,161.38
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	62,317,160.37	62,495,401.63
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负债：		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	16,000,000.00	13,800,000.00
应付证券清算款	217,753.44	236,865.11
应付赎回款	6,144.44	17,869.55
应付管理人报酬	27,344.54	28,619.05
应付托管费	7,812.77	8,176.89
应付销售服务费	9,111.96	9,008.60
应付交易费用	13,398.51	66,159.74
应交税费	521,002.22	519,918.40
应付利息	-3,443.28	-5,512.87
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	470,009.18	495,008.27
负债合计	17,269,133.78	15,176,112.74
所有者权益：		
实收基金	46,999,125.31	43,313,952.04
未分配利润	-1,951,098.72	4,005,336.85
所有者权益合计	45,048,026.59	47,319,288.89
负债和所有者权益总计	62,317,160.37	62,495,401.63

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额总额46,999,125.31份，其中A类基金份额净值0.9737元，A类基金份额19,302,937.51份；C类基金份额净值0.9479元，C类基金份额27,696,187.80份。

7.2 利润表

会计主体：富安达增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入	-4,609,070.89	-324,704.27
1.利息收入	573,316.66	666,851.73
其中：存款利息收入	30,522.98	29,522.52
债券利息收入	542,793.68	637,329.21
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	–
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	-1,901,410.38	-1,376,312.57
其中：股票投资收益	-564,629.88	351,918.22
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-1,383,547.37	-1,830,685.39
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	46,766.87	102,454.60
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-3,283,810.12	380,608.28
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	2,832.95	4,148.29
减：二、费用	1,650,712.83	1,924,176.32
1. 管理人报酬	336,346.12	358,323.55
2. 托管费	96,098.95	102,378.24
3. 销售服务费	112,122.18	112,556.70
4. 交易费用	404,193.57	624,893.78
5. 利息支出	559,152.88	555,169.05
其中：卖出回购金融资产支出	559,152.88	555,169.05
6. 税金及附加	1,419.13	–
7. 其他费用	141,380.00	170,855.00
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-6,259,783.72	-2,248,880.59
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-6,259,783.72	-2,248,880.59

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	43,313,952.04	4,005,336.85	47,319,288.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-6,259,783.72	-6,259,783.72
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）	3,685,173.27	303,348.15	3,988,521.42
其中：1.基金申购款	11,522,512.17	728,470.96	12,250,983.13
2.基金赎回款	-7,837,338.90	-425,122.81	-8,262,461.71
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）	46,999,125.31	-1,951,098.72	45,048,026.59
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	43,212,924.61	6,069,370.51	49,282,295.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-2,248,880.59	-2,248,880.59
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）	101,027.43	184,846.93	285,874.36
其中：1.基金申购款	26,862,845.82	4,843,920.18	31,706,766.00
2.基金赎回款	-26,761,818.39	-4,659,073.25	-31,420,891.64
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）	43,313,952.04	4,005,336.85	47,319,288.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富安达增强收益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")证监许可[2012]635号《关于核准富安达增强收益债券型证券投资基金募集的批复》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《富安达增强收益债券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606,170,350.17元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第258号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》于2012年7月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为606,269,167.85份基金份额，其中认购资金利息折合98,817.68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《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》和《富安达增强收益债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购费/申购费的，称为A类基金份额；不收取认购费/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达增强收益债券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，包括债券、股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、银行存款、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金主要投资于国债、政策金融债、央行票据、地方政府债、商业银行金融债与次级债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购等固定收益品种。本基金可投资股票、权证等权益类资产。本基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%，股票、权证等权益类品种投资比例不超过基金资产的20%，现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中债总指数收益率×90%＋沪深300 指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人富安达基金管理有限公司于2019年3月29日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富安达增强收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7关联方关系

本报告期内，关联方关系未发生变化。

关联方名称	与本基金的关系
富安达基金管理有限公司（"富安达基金"）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易业务。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易业务。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易业务。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易业务。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	336,346.12	358,323.55
其中：支付销售机构的客户维护费	45,244.94	58,652.94

1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.7%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：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 ×0.7% / 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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	96,098.95	102,378.24

1.支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.2%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：日基金托管费＝前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C	合计
交通银行	–	8,151.39	8,151.39
富安达基金	–	66,434.83	66,434.83
南京证券	–	22,601.21	22,601.21
合计	0.00	97,187.43	97,187.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C	合计
富安达基金	–	60,001.84	60,001.84
交通银行	–	11,688.61	11,688.61
南京证券	–	25,130.94	25,130.94
合计	–	96,821.39	96,821.39

1. 支付基金销售机构的增强收益C类销售服务费按前一日增强收益C类基金资产净值0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给富安达基金，再由富安达基金计算并支付给各基金销售机构。增强收益A类不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费＝前一日增强收益C类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

富安达增强收益债券A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
基金合同生效日（2012年07月25日）持有的基金份额	–	–
报告期初持有的基金份额	–	–
报告期间申购/买入总份额	–	–
报告期间因拆分变动份额	–	–
减：报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	–	–
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

富安达增强收益债券C

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
基金合同生效日（2012年07月25日）持有的基金份额	–	–
报告期初持有的基金份额	4,873,456.05	4,873,456.05
报告期间申购/买入总份额	–	–
报告期间因拆分变动份额	–	–
减：报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	4,873,456.05	4,873,456.05
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.60%	20.12%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

富安达增强收益债券A

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017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	2,419,728.92	12.54%	2,419,728.92	12.68%

富安达增强收益债券C

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017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	11,388,029.60	41.12%	7,695,267.41	31.77%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	75,087.68	1,749.99	76,293.66	3,821.85

1、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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新股/新债而于期末流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额16,000,000.00元（共1笔），于2019年1月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为54,891,476.00元，属于第二层次的余额为5,033,040.00元，无属于第三层次的余额(2017年12月31日：第一层次51,568,872.77元，第二层次8,482,993.70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2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

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	8,604,946.00	13.81
	其中：股票	8,604,946.00	13.81
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	51,319,570.00	82.35
	其中：债券	51,319,570.00	82.35
	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	1,741,768.03	2.80
8	其他各项资产	650,876.34	1.04
9	合计	62,317,160.37	100.00

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	7,480,546.00	16.61
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	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	415,650.00	0.92
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	708,750.00	1.57
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	8,604,946.00	19.10

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002048	宁波华翔	100,000	1,043,000.00	2.32
2	600810	神马股份	96,700	974,736.00	2.16
3	600585	海螺水泥	31,000	907,680.00	2.01
4	600622	光大嘉宝	125,000	708,750.00	1.57
5	000568	泸州老窖	15,300	622,098.00	1.38
6	600197	伊力特	45,000	586,350.00	1.30
7	300373	扬杰科技	38,000	548,720.00	1.22
8	000768	中航飞机	40,000	529,600.00	1.18
9	603713	密尔克卫	15,000	415,650.00	0.92
10	000830	鲁西化工	38,000	372,400.00	0.83

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	002048	宁波华翔	7,479,634.00	15.81
2	600810	神马股份	5,195,261.00	10.98
3	300323	华灿光电	3,400,827.00	7.19
4	300433	蓝思科技	3,288,394.00	6.95
5	603019	中科曙光	3,281,347.00	6.93
6	002258	利尔化学	3,079,298.94	6.51
7	603826	坤彩科技	2,585,232.10	5.46
8	603496	恒为科技	2,522,627.60	5.33
9	300545	联得装备	2,171,160.00	4.59
10	002146	荣盛发展	2,058,830.00	4.35
11	600720	祁连山	1,988,099.00	4.20
12	600835	上海机电	1,837,026.00	3.88
13	300136	信维通信	1,818,599.68	3.84
14	300373	扬杰科技	1,757,674.00	3.71
15	002496	辉丰股份	1,755,420.00	3.71
16	002036	联创电子	1,728,392.00	3.65
17	000768	中航飞机	1,492,662.27	3.15
18	600837	海通证券	1,456,718.00	3.08
19	002497	雅化集团	1,429,305.25	3.02
20	000933	神火股份	1,423,696.92	3.01
21	600093	易见股份	1,414,670.00	2.99
22	601877	正泰电器	1,312,358.00	2.77
23	300302	同有科技	1,296,948.38	2.74
24	000525	红 太 阳	1,292,526.00	2.73
25	600230	沧州大化	1,292,006.00	2.73
26	000818	航锦科技	1,236,151.00	2.61
27	601166	兴业银行	1,213,388.00	2.56
28	002043	兔 宝 宝	1,195,280.30	2.53
29	002562	兄弟科技	1,179,700.00	2.49
30	002405	四维图新	1,167,443.00	2.47
31	600801	华新水泥	1,165,178.00	2.46
32	300340	科恒股份	1,139,410.96	2.41
33	000555	神州信息	1,118,640.00	2.36
34	000988	华工科技	1,099,310.00	2.32
35	600585	海螺水泥	1,082,031.00	2.29
36	000921	海信家电	1,068,928.00	2.26
37	002185	华天科技	1,064,645.00	2.25
38	300059	东方财富	1,029,413.00	2.18
39	300287	飞利信	1,028,485.00	2.17
40	000717	韶钢松山	1,018,569.00	2.15

1、"买入金额"按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	002048	宁波华翔	7,335,870.34	15.50
2	600810	神马股份	4,275,725.20	9.04
3	603019	中科曙光	4,123,840.23	8.71
4	300323	华灿光电	3,492,692.13	7.38
5	300433	蓝思科技	3,392,833.78	7.17
6	002258	利尔化学	3,187,702.40	6.74
7	603826	坤彩科技	2,724,214.00	5.76
8	603496	恒为科技	2,608,602.98	5.51
9	300136	信维通信	1,980,448.69	4.19
10	002146	荣盛发展	1,934,038.96	4.09
11	300545	联得装备	1,920,875.32	4.06
12	600720	祁连山	1,900,875.68	4.02
13	002496	辉丰股份	1,804,350.00	3.81
14	000910	大亚圣象	1,605,279.00	3.39
15	002036	联创电子	1,560,421.00	3.30
16	002497	雅化集团	1,496,677.55	3.16
17	600835	上海机电	1,476,420.00	3.12
18	600230	沧州大化	1,364,246.00	2.88
19	300302	同有科技	1,334,456.00	2.82
20	600522	中天科技	1,295,800.00	2.74
21	600093	易见股份	1,278,925.00	2.70
22	000525	红 太 阳	1,272,770.00	2.69
23	002156	通富微电	1,266,415.00	2.68
24	601166	兴业银行	1,236,542.40	2.61
25	000818	航锦科技	1,228,747.32	2.60
26	600837	海通证券	1,225,356.00	2.59
27	002405	四维图新	1,214,124.00	2.57
28	601877	正泰电器	1,207,344.00	2.55
29	002043	兔 宝 宝	1,197,960.00	2.53
30	000933	神火股份	1,197,500.00	2.53
31	002562	兄弟科技	1,191,819.00	2.52
32	600801	华新水泥	1,184,486.84	2.50
33	000555	神州信息	1,148,116.00	2.43
34	300340	科恒股份	1,146,854.00	2.42
35	000988	华工科技	1,111,000.00	2.35
36	000921	海信家电	1,101,149.01	2.33
37	300373	扬杰科技	1,091,531.64	2.31
38	300287	飞利信	1,064,424.00	2.25
39	300059	东方财富	1,035,840.00	2.19
40	002185	华天科技	988,990.38	2.09
41	002434	万里扬	972,399.00	2.05
42	300053	欧比特	951,508.29	2.01

1、"卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	138,218,668.68
卖出股票收入（成交）总额	136,709,644.18

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	2,711,880.00	6.02
	其中：政策性金融债	2,711,880.00	6.02
4	企业债券	2,321,160.00	5.15
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	46,286,530.00	102.75
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	51,319,570.00	113.92

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	113013	国君转债	39,500	4,150,660.00	9.21
2	113011	光大转债	39,000	4,099,680.00	9.10
3	113009	广汽转债	40,050	4,056,664.50	9.01
4	128015	久其转债	43,100	4,003,128.00	8.89
5	128010	顺昌转债	34,520	3,353,618.00	7.44

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,445.59
2	应收证券清算款	341,046.70
3	应收股利	–
4	应收利息	295,583.86
5	应收申购款	800.19
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	650,876.34

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113013	国君转债	4,150,660.00	9.21
2	113011	光大转债	4,099,680.00	9.10
3	113009	广汽转债	4,056,664.50	9.01
4	128015	久其转债	4,003,128.00	8.89
5	128010	顺昌转债	3,353,618.00	7.44
6	132013	17宝武EB	3,277,560.00	7.28
7	123007	道氏转债	3,243,708.00	7.20
8	123009	星源转债	2,954,940.80	6.56
9	110034	九州转债	2,841,806.80	6.31
10	132006	16皖新EB	2,048,200.00	4.55
11	128014	永东转债	1,839,616.20	4.08
12	132009	17中油EB	1,713,430.00	3.80
13	113503	泰晶转债	1,223,632.80	2.72
14	110033	国贸转债	1,032,900.00	2.29
15	113511	千禾转债	276,480.00	0.61

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未发现存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

§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

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
富安达增强收益债券A	767	25,166.80	2,428,417.29	12.58%	16,874,520.22	87.42%
富安达增强收益债券C	824	33,611.88	16,261,485.65	58.71%	11,434,702.15	41.29%
合计	1,591	29,540.62	18,689,902.94	39.77%	28,309,222.37	60.23%

9.2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	富安达增强收益债券A	54,822.35	0.28%
	富安达增强收益债券C	0.00	0.00%
	合计	54,822.35	0.12%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	富安达增强收益债券A	0
	富安达增强收益债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达增强收益债券A	0
	富安达增强收益债券C	0
	合计	0

1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为0。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达增强收益债券A	富安达增强收益债券C
基金合同生效日(2012年07月25日)基金份额总额	204,823,108.94	401,446,058.91
本报告期期初基金份额总额	19,090,185.35	24,223,766.69
本报告期基金总申购份额	2,536,313.88	8,986,198.29
减：本报告期基金总赎回份额	2,323,561.72	5,513,777.18
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	19,302,937.51	27,696,187.80

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动：

2018年5月19日，公司发布《富安达基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，张丽琅女士因已届法定退休年龄离任公司督察长，公司聘任李理想同志担任公司督察长。

2018年7月18日，公司股东会选举胥海先生担任股东董事。

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

上述变动中的高级管理人员变更事项已按规定报中国证监会上海监管局及中国基金业协会备案。

本报告期内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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为60,000元人民币。

截至本报告期末，该事务所已向本基金提供7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	
西南证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
海通证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
西部证券	1	–	–	–	–	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–
新时代证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	3,797,258.00	1.38%	3,536.39	1.48%	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
红塔证券	1	–	–	–	–	–
银河证券	1	–	–	–	–	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
中金公司	1	–	–	–	–	–
中泰证券	2	–	–	–	–	–
招商证券	2	–	–	–	–	–
中信证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	2	–	–	–	–	–
中信建投	2	4,917,358.69	1.79%	3,596.15	1.50%	–
申万宏源	2	–	–	–	–	–
中投证券	2	–	–	–	–	–
华龙证券	2	–	–	–	–	–
南京证券	2	–	–	–	–	–
东兴证券	2	15,015,060.97	5.46%	13,983.63	5.84%	–
华宝证券	2	–	–	–	–	–
西藏东财	2	–	–	–	–	–
天风证券	2	–	–	–	–	–
国盛证券	2	–	–	–	–	–
兴业证券	2	–	–	–	–	–
太平洋证券	2	7,741,446.42	2.82%	5,661.33	2.37%	–
国信证券	2	8,203,893.25	2.98%	5,999.46	2.51%	–
国海证券	2	63,061,674.59	22.94%	46,116.55	19.28%	–
东方证券	2	152,760,853.98	55.57%	142,267.03	59.46%	–
国金证券	2	19,419,246.96	7.06%	18,085.13	7.56%	–
方正证券	2	–	–	–	–	–
长江证券	2	–	–	–	–	–
华金证券	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、个股分析的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；能够提供良好的交易执行。

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。

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，(41343) 国盛证券、(006334) 国盛证券、(004925) 西部证券、(006541)天风证券、(41550)天风证券、(007029)太平洋证券、(42452)太平洋证券、(40685)华泰证券、(005995)华泰证券为本基金本期新增的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
西南证券	–	–	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–	–	–
新时代证券	–	–	–	–	–	–	–	–
光大证券	578,200.00	0.28%	28,200,000.00	0.73%	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–	–	–
红塔证券	–	–	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中信建投	2,240,814.24	1.08%	242,200,000.00	6.29%	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–	–	–
华龙证券	–	–	–	–	–	–	–	–
南京证券	–	–	–	–	–	–	–	–
东兴证券	4,796,552.25	2.31%	–	–	–	–	–	–
华宝证券	–	–	–	–	–	–	–	–
西藏东财	–	–	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–	–	–
国盛证券	–	–	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–	–	–
太平洋证券	10,941,065.73	5.26%	406,700,000.00	10.57%	–	–	–	–
国信证券	2,225,094.32	1.07%	–	–	–	–	–	–
国海证券	85,034,978.13	40.89%	2,811,300,000.00	73.05%	–	–	–	–
东方证券	77,801,646.22	37.41%	–	–	–	–	–	–
国金证券	24,334,207.82	11.70%	360,200,000.00	9.36%	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–	–	–
华金证券	–	–	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–	–	–

§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	2018年1月1日-2018年12月31日	10,114,996.33	3,692,762.19	0.00	13,807,758.52	29.38%
个人	1	2018年1月1日-2018年12月31日	10,029,526.94	0.00	0.00	10,029,526.94	21.34%
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

富安达基金管理有限公司

二〇一九年三月三十日