富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人：富安达基金管理有限公司
基金托管人：南京银行股份有限公司
送出日期：2019年08月27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。本半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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富安达行业轮动混合
基金主代码	001660
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年04月04日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	南京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	76,879,599.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型，辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

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	南京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李理想	王峰
	联系电话	021-61870999	021-24198808
	电子邮箱	service@fadfunds.com	wangf@nicbtg.com
客户服务电话		400-630-6999	95302
传真		021-61870888	021-54662130

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金半年度报告备置地点	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（2019年01月01日－2019年06月30日）
本期已实现收益	14,350,867.39
本期利润	37,529,000.52
加权平均基金份额本期利润	0.2595
本期基金份额净值增长率	17.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.0076
期末基金资产净值	77,465,516.15
期末基金份额净值	1.008

注：

①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.75%	1.00%	3.50%	0.68%	-0.75%	0.32%
过去三个月	-4.45%	1.49%	-0.39%	0.90%	-4.06%	0.59%
过去六个月	17.35%	1.41%	16.57%	0.92%	0.78%	0.49%
过去一年	5.99%	1.26%	8.56%	0.91%	-2.57%	0.35%
自基金合同生效起至今	0.80%	1.16%	3.67%	0.87%	-2.87%	0.29%

注：

①本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。

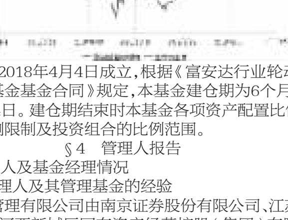
②本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

Return t =60%×[沪深300指数t/沪深300指数 (t-1)-1]+40%×[中债总指数t/中债总指数(t-1)-1]

Benchmark t =（1+Return t）×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



注：本基金于2018年4月4日成立，根据《富安达行业轮动灵活配置混合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2018年10月4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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2019年06月30日，公司共管理十只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金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、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
毛矛	本基金的基金经理	2018-04-04	-	15年	硕士。历任中华资源（香港）有限公司交易员；易唯思商务咨询有限公司投资分析师；光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2012年4月加入富安达基金管理有限公司任高级行业研究员兼基金经理助理。2015年5月起任富安达策略精选灵活配置混合型基金、富安达健康人生灵活配置混合型基金的基金经理（2015年11月25日至2016年12月17日期间）、富安达新动力灵活配置混合型基金、富安达消费主题灵活配置混合型基金、富安达行业轮动灵活配置混合型基金的基金经理。
朱义	本基金的基金经理	2018-11-30	-	16年	硕士。历任金元顺安基金管理有限公司风险管理专员；上投摩根基金管理有限公司高级风险管理经理；富安达基金管理有限公司监察稽核部副总监、研究发展部研究总监助理兼基金经理助理。2018年4月起任富安达长盈灵活配置混合型基金、富安达新动力灵活配置混合型基金、富安达行业轮动灵活配置混合型基金的基金经理。

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》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达行业轮动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，未发现本基金存在异常交易行为。

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

今年以来，在社融数据、货币政策、流动性改善基础上，市场在2018年趋势性下跌后迎来了比较大幅的反弹。从指数来看，上半年沪深300涨27%，上证50涨27.8%，创业板指涨20.9%，中小板指涨20.75%。大市值公司相对有更好的表现。二季度中后期市场进入调整阶段，一方面是四月市场担心货币政策边际有所调整；二是五月美国针对华为禁令出台，中美贸易摩擦又有进一步升级的趋势。在市场估值回归完成之后，市场风险偏好快速下滑。本基金保持了较高持仓，主要配置在金融、地产、中游制造业等低估值行业以及家电、食品饮料等消费类行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，富安达行业轮动混合基金份额净值为1.008元。本报告期内基金份额净值增长率为17.35%，同期业绩比较基准收益率为16.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，虽然2019年下半年经济仍处于下行筑底阶段，但减税降费、供给侧改革等一系列宏观对冲政策为经济托底，预计总体经济失速下滑的风险小。国际环境随着中美贸易谈判重启，中美贸易摩擦长期化和常规化，对经济和市场的冲击边际减弱，市场风险偏好正在逐步恢复。与全球股市相比，A股市场估值也处于合理偏低位置，特别是代表中国核心资产的龙头企业，在存量经济结构中越来越体现出市场占有率提升、增长确定性高和抗经济下行风险的特质。另外，随着政府对科技创新的大力支持，5G产业链、电子、计算机云计算等亦有配置机会。本基金将从这些行业中选择投资优秀有潜力的公司，尽力为基金持有人获取较好的投资回报。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

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行业轮动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行业轮动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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金投资基金的半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	6,958,301.01	51,644,015.80
结算备付金	-	38,131.12
存出保证金	118,340.85	181,326.97
交易性金融资产	70,092,552.35	142,157,824.99
其中：股票投资	70,092,552.35	139,540,824.99
基金投资	-	-
债券投资	-	2,617,000.00
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	531,316.12	-
应收利息	1,618.67	84,242.39
应收股利	-	-
应收申购款	795.68	596.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	34,286.46	-
资产总计	77,737,211.14	194,106,138.14
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	44,973.29	4,300,073.00
应付管理人报酬	59,577.10	153,338.15
应付托管费	16,549.19	42,593.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	60,675.14	6,432.63
应交税费	-	229.51
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	89,920.27	136,206.31
负债合计	271,694.99	4,638,873.56
所有者权益：		
实收基金	76,879,599.41	220,447,919.24
未分配利润	585,916.74	-30,980,654.66
所有者权益合计	77,465,516.15	189,467,264.58
负债和所有者权益总计	77,737,211.14	194,106,138.14

报告截止日2019年06月30日，基金份额净值1.008元，基金份额总额76,879,599.41份。

6.2 利润表

会计主体：富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
一、收入	38,774,560.10	-11,808,962.06
1.利息收入	135,022.51	2,035,612.42
其中：存款利息收入	74,863.69	1,550,743.40
债券利息收入	24,274.86	12,863.36
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	35,883.96	472,005.66
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	15,303,610.38	-4,752,187.15
其中：股票投资收益	13,735,023.14	-5,969,774.69
基金投资收益	-	-
债券投资收益	325,497.08	-
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	1,243,090.16	1,217,587.54
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	23,178,133.13	-9,619,974.07
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	157,794.08	527,586.74
减：二、费用	1,245,559.58	1,301,882.79
1. 管理人报酬	625,556.06	747,816.68
2. 托管费	173,765.61	207,726.81
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	312,000.29	307,098.33
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	80.11	18.01
7. 其他费用	134,157.51	39,222.96
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	37,529,000.52	-13,110,844.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	37,529,000.52	-13,110,844.85

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019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)	220,447,919.24	-30,980,654.66	189,467,264.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,529,000.52	37,529,000.52
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）	-143,568,319.83	-5,962,429.12	-149,530,748.95
其中：1.基金申购款	2,771,507.35	-109,717.40	2,661,789.95
2.基金赎回款	-146,339,827.18	-5,852,711.72	-152,192,538.90
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）	76,879,599.41	585,916.74	77,465,516.15
项目	上年度可比期间 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018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)	405,878,750.21	-	405,878,750.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,110,844.85	-13,110,844.85
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）	-140,728,060.73	109,745.28	-140,618,315.45
其中：1.基金申购款	71,486.51	-958.48	70,528.03
2.基金赎回款	-140,799,547.24	110,703.76	-140,688,843.48
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）	265,150,689.48	-13,001,099.57	252,149,589.91

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富安达行业轮动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")《关于准予富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1443号)批准，并于2017年3月16日获中国证监会证券基金机构监管部《关于富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函[2017]710号)的许可，以及2017年11月2日获中国证监会证券基金机构监管部《关于同意富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的函》（机构部函[2017]2502号）的许可延期募集。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《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2018年4月4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405,878,750.21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，基金托管人为南京银行股份有限公司(以下简称"南京银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、资产支持证券、货币市场工具、衍生工具（权证、股指期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-95%；投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-100%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的3%，任何交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券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为：沪深300指数收益率×60%+中债券总指数收益率×40%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。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。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.4中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2019年06月30日的财务状况以及自2019年01月01日至2019年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 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
南京银行股份有限公司（"南京银行"）	基金托管人、基金销售机构
南京证券股份有限公司（"南京证券"）	基金管理人的股东、基金销售机构
江苏交通控股有限公司（"江苏交通"）	基金管理人的股东
南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司（"南京河西"）	基金管理人的股东
富安达资产管理（上海）有限公司（"富安达资管"）	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
南京证券	159,684,407.97	93.21%	112,384,427.51	41.71%

6.4.8.1.2 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交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
南京证券	402,300,000.00	100.00%	962,100,000.00	33.12%

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019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	148,713.77	93.21%	60,675.14	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018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	104,663.68	47.67%	104,663.68	4767.00%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	625,556.06	747,816.68
其中：支付销售机构的客户维护费	88,016.73	113,395.87

注：

①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.9%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.9%/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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	173,765.61	207,726.81

注：

支付基金托管人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。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.8.3 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（回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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

关联方名称	本期末 2019年06月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2018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
富安达资管	9,999,000.00	13.01%	9,999,000.00	4.54%
南京证券	-	-	7,499,000.00	3.40%

6.4.8.5 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 2019年01月01日至2019年06月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2018年04月04日（基金合同生效日）至2018年06月30日 期末余额	当期利息收入
南京银行股份有限公司	6,958,301.01	68,913.93	39,552,314.78	157,916.55

注：本基金的银行存款由基金托管人南京银行保管，活期存款按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 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均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2019年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一层次的余额为70,058,682.41元，属于第二层次的余额为33,869.94元，无属于第三层次的余额。(2018年12月31日：第一层次139,540,824.99元，第二层次2,617,000元，无第三层次的余额)。

(a) 第二层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

§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	70,092,552.35	90.17
	其中：股票	70,092,552.35	90.17
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	6,958,301.01	8.95
8	其他各项资产	686,357.78	0.88
9	合计	77,737,211.14	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	423,878.00	0.55
B	采矿业	255,264.48	0.33
C	制造业	37,485,372.67	48.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,882,428.64	3.72
E	建筑业	1,984,014.50	2.56
F	批发和零售业	1,412,488.03	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	125,923.72	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	131,620.44	0.17
J	金融业	6,217,759.42	8.03
K	房地产业	18,326,499.25	23.66
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	847,303.20	1.09
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	70,092,552.35	90.48

7.3 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	000651	格力电器	97,672	5,371,960.00	6.93
2	600048	保利地产	395,770	5,050,025.20	6.52
3	000902	新洋丰	320,856	3,442,784.88	4.44
4	000002	万科A	98,247	2,732,249.07	3.53
5	002146	荣盛发展	275,492	2,586,869.88	3.34
6	600466	蓝光发展	410,583	2,553,826.26	3.30
7	600176	中国巨石	252,684	2,408,078.52	3.11
8	601877	正泰电器	101,867	2,352,109.03	3.04
9	601288	农业银行	580,153	2,088,550.80	2.70
10	601668	中国建筑	345,046	1,984,014.50	2.56

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半年度报告正文。

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	600015	华夏银行	8,800,907.00	4.65
2	300036	超图软件	2,099,645.00	1.11
3	300450	先导智能	2,069,609.35	1.09
4	300149	量子生物	2,058,599.00	1.09
5	300356	光一科技	1,964,032.00	1.04
6	603833	欧派家居	1,955,120.00	1.03
7	300082	奥克股份	1,948,779.00	1.03
8	600089	特变电工	1,948,629.00	1.03
9	002714	牧原股份	1,904,440.00	1.01
10	002332	仙琚制药	1,600,884.00	0.84
11	300146	汤臣倍健	1,533,610.00	0.81
12	000063	中兴通讯	1,520,372.00	0.80
13	600996	贵广网络	981,700.00	0.52
14	000100	TCL 集团	945,974.00	0.50
15	002008	大族激光	389,347.00	0.21
16	600989	宝丰能源	266,324.00	0.14
17	600928	西安银行	86,448.96	0.05
18	002958	青农商行	70,092.00	0.04
19	002955	鸿合科技	58,070.28	0.03
20	603967	中创物流	38,575.76	0.02

"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	600048	保利地产	12,928,762.05	6.82
2	600015	华夏银行	8,407,243.19	4.44
3	601318	中国平安	6,376,411.64	3.37
4	002332	仙琚制药	5,475,581.19	2.89
5	002146	荣盛发展	5,297,563.44	2.80
6	601601	中国太保	3,938,526.70	2.08
7	002327	富安娜	3,646,733.30	1.92
8	000651	格力电器	3,540,851.26	1.87
9	000002	万科A	3,341,320.30	1.76
10	300012	华测检测	3,341,226.20	1.76
11	600167	联美控股	3,048,211.55	1.61
12	600529	山东药玻	3,046,148.64	1.61
13	601288	农业银行	3,019,393.37	1.59
14	002293	罗莱生活	2,942,454.66	1.55
15	603359	东珠生态	2,632,273.56	1.39
16	000650	仁和药业	2,436,741.06	1.29
17	002714	牧原股份	2,408,162.05	1.27
18	300082	奥克股份	2,385,509.49	1.26
19	600089	特变电工	2,313,684.13	1.22
20	603833	欧派家居	2,241,918.86	1.18

"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	32,900,393.09
卖出股票收入（成交）总额	139,587,319.08

"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。

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 本基金投资前十名股票未超出基金合同规定备选库。

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	118,340.85
2	应收证券清算款	531,316.12
3	应收股利	-
4	应收利息	1,618.67
5	应收申购款	795.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	34,286.46
8	其他	-
9	合计	686,357.78

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
1,287	59,735.51	10,003,428.45	13.01%	66,876,170.96	86.99%

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	0.00	0.00%

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

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。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年04月04日)基金份额总额	405,878,750.21
本报告期期初基金份额总额	220,447,919.24
本报告期基金总申购份额	2,771,507.35
减：本报告期基金总赎回份额	146,339,827.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	76,879,599.41

§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，本基金管理人的重大人事变动：

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

2019年5月29日，公司召开全体职工大会免去孙爱民先生职工监事职务。

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

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。

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未发生变化，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，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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
南京证券	2	159,684,407.97	93.21%	148,713.77	94.59%	-
华泰证券	2	11,624,558.46	6.79%	8,501.03	5.41%	-

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；能够提供很好的交易执行。

②券商专用交易单元选择程序：

（一）券商席位由投资管理部与研究发展部业务人员推荐，经投资管理部、研究发展部部门会议讨论，形成重点评估的券商备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的券商个数不得少于最后选择个数的二倍。

（二）投资管理部、研究发展部全体业务人员遵照券商选择标准的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成券商排名及专用席位租用意见，报公司总经理批准。

（三）公司应与被选择的券商签订书面委托代理协议，明确双方公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

（四）若签约券商的服务不能满足要求，或签约券商违法违规受到国家有关部门的处罚，公司可以提前终止签署的协议，并撤销租用的席位。

③本基金本报告期内无新增或剔除的交易单元。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
南京证券	-	-	402,300,000.00	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 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

二〇一九年八月二十七日