

# 富达蔚然 2 号 FOF 集合资产管理计划

2024 年第二季度报告

2024 年 06 月 30 日

资产管理人：富达基金管理（中国）有限公司

资产托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 07 月 31 日

## § 1 重要提示

资产管理人保证本报告内容的真实性、准确性和完整性，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

资产托管人中国银行股份有限公司根据本资产管理计划合同规定，于 2024 年 7 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产，但不保证资产管理计划一定盈利。

资产管理计划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资产管理计划的计划说明书和风险揭示书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	富达蔚然 2 号 FOF 集合资产管理计划
资产管理计划主代码	SABZ69
资产管理计划运作方式	契约型定期开放式
资产管理计划成立日	2023-12-06
报告期末资产管理计划份额总额	11,480,762.05
业绩比较基准（若有）	-
资产管理人	富达基金管理（中国）有限公司
资产托管人	中国银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	2024年04月01日-2024年06月30日
1. 本期已实现收益	54,938.50
2. 本期利润	88,446.68
3. 加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0071
4. 期末资产管理计划资产净值	11,888,812.21
5. 期末资产管理计划份额净值	1.0355

注：本期已实现收益指计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 资产管理计划净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.86%	0.12%	-	-	-	-
过去六个月	2.94%	0.16%	-	-	-	-
自资产管理 计划成立起 至本报告期 末	3.55%	0.15%	-	-	-	-

注：本计划成立日为 2023 年 12 月 06 日，自资产管理计划成立日起至报告期末未满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 报告期内发生的投资经理变更

本报告期内本产品无投资经理变更。

### 4.2 报告期内资产管理计划的投资策略和运作分析

本组合希望通过适当配置于全球资产给持有者带来相对稳健的收益体验。

权益资产部分，海外资产的核心驱动国家美国大概率会实现软着陆，有利于特别是发达市场国家的资产进一步走出慢牛行情。我们继续持有今年企业盈利较好的美国和日本市场，印度市场近期继续创新高，预计四季度美联储开始降息后，我们布局的其他新兴市场将有更大弹性。我们预计中国股市总体结构或是大盘强小盘弱、红利强成长弱。我们建议关注短期的反弹，重要会议后根据政策预期调整风险仓位，在后续市场出现调整或者有明确需求端政策出台时配置国内市场。

固定收益部分，美国利率短期高点已过，欧洲率先在发达市场中降息。国内债券市场短期供需开始预期平衡，但由于基本面维持资产荒，我们认为长牛格局没有变化。

其它方面，贵金属头寸在回调后继续走高概率较大，央行购买黄金、利率预期向下、地缘政治不稳定等因素共振推动长牛走势。

### 4.3 两费及业绩报酬说明

单位：人民币元

项目	本报告期
当期发生的管理费	19,052.22
当期发生的托管费	526.67
当期发生的业绩报酬	542.61

注：

管理费按前一日资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每季季末，按季支付。其计算公式为：日管理费 = 前一日资产净值 × 0.6% ÷ 当年天数。

托管费按前一日资产净值 0.02% 的年费率计提，逐日累计至每季季末，按季支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日资产净值 × 0.02% ÷ 当年天数。

本资产管理计划业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式参见本资产管理计划的资产管理合同。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占计划总资产的比例（%）
1	权益投资	147,482.62	1.24
	其中：股票	147,482.62	1.24
2	基金投资	10,697,616.47	89.76
3	固定收益投资	411,364.93	3.45
	其中：债券	411,364.93	3.45
	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	467,340.42	3.92
8	其他各项资产	194,833.20	1.63
9	合计	11,918,637.64	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 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）	占计划资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	84,122.00	0.71
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	11,266.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	9,621.00	0.08

	术服务业		
J	金融业		-
K	房地产业	20,907.00	0.18
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		-
G	合计	125,916.00	1.06

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占计划资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	10,139.87	0.09
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	11,426.75	0.10
工业	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	21,566.62	0.18

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 5.3 报告期末按公允价值占计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占计划资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	301004	嘉益股份	500.00	45,500.00	0.38
2	603338	浙江鼎力	300.00	18,126.00	0.15
3	00241	阿里健康	4,000.00	11,426.75	0.10
4	601021	春秋航空	200.00	11,266.00	0.09
5	600048	保利发展	1,200.00	10,512.00	0.09
6	000002	万科A	1,500.00	10,395.00	0.09
7	300124	汇川技术	200.00	10,260.00	0.09
8	002831	裕同科技	400.00	10,236.00	0.09
9	03690	美团-W	100.00	10,139.87	0.09
10	603383	顶点软件	300.00	9,621.00	0.08

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

#### 5.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占计划资产净值比例（%）
1	国家债券	411,364.93	3.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债（可交换债）	-	-
9	同业存单	-	-
10	其他	-	-
11	合计	411,364.93	3.46

#### 5.5 报告期末按公允价值占计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占计划资产净值比例（%）
1	019710	23 国债 17	4,000.00	411,364.93	3.46

#### 5.6 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排序的前十名资产管理产品投资明细

序号	产品代码	产品名称	持有份额（份）	公允价值（元）	占计划资产净值比例（%）
1	100050	富国全球债券(QDII)A	1,157,898.88	1,507,931.71	12.6836
2	161120	易方达中债新	700,369.29	1,145,383.94	9.6341

		综合债券指数 (LOF)C			
3	003071	国联睿祥纯债 债券 A	787,835.82	1,034,428.43	8.7009
4	002881	中加丰润纯债 债券 A	924,008.74	1,032,672.17	8.6861
5	003082	国联上海清算 所银行间 1-3 年中高等级信 用债指数 C	925,667.87	1,022,770.43	8.6028
6	007253	广发中债农发 行债券总指数 C	926,955.88	996,106.79	8.3785
7	270044	广发双债添利 债券 A	797,117.65	983,802.60	8.275
8	159659	纳斯达克 100ETF	209,800.00	327,078.20	2.7511
9	518880	黄金 ETF	60,700.00	321,527.90	2.7045
10	019449	摩根日本精选 股票(QDII)C	183,926.19	295,863.67	2.4886

### 5.7 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本计划本报告期期末未持有资产支持证券。

### 5.8 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本计划本报告期期末未持有贵金属。

### 5.9 报告期末按公允价值占计划财产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本计划本报告期期末未持有权证。

### 5.10 报告期末本计划投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险指标说明
IF2409	沪深 300 股指期货 2409 合约	1	1,027,08 0.00	1,440.00	-

公允价值变动总额合计（元）	1,440.00
股指期货投资本期收益（元）	-26.95
股指期货投资本期公允价值变动（元）	1,440.00

### 5.11 报告期末本计划投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动（元）	风险指标说明
TS2412	票面利率 3%的 2 年 期名义中 短期国债 期货 2412 合约	2	4,077,12 0.00	5,920.00	-
公允价值变动总额合计（元）				5,920.00	
国债期货投资本期收益（元）				-6.60	
国债期货投资本期公允价值变动（元）				5,920.00	

### 5.12 报告期末本计划持有的处于转股期的可转换债券明细

本计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.13 投资组合报告的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 其他事项

### 6.1 关联方名单

关联方名称	与本资产管理计划的关系
富达基金管理（中国）有限公司（“富达基金”）	资产管理人
富达亚洲控股私人有限公司	资产管理人控股股东
中国银行股份有限公司	资产管理人托管人
中央汇金投资有限责任公司	资产管理人托管人关联方
香港中央结算（代理人）有限公司	资产管理人托管人关联方
中国证券金融股份有限公司	资产管理人托管人关联方
中央汇金资产管理有限责任公司	资产管理人托管人关联方
香港中央结算有限公司	资产管理人托管人关联方
MUFG Bank, Ltd	资产管理人托管人关联方



中国太平洋人寿保险股份有限公司-中国太平洋人寿股票红利型产品（寿自营）委托投资（长江养老）	资产管理人托管人关联方
中国人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品-005L-CT001 沪	资产管理人托管人关联方
光大证券股份有限公司	资产管理人托管人关联方
招商银行股份有限公司-上证红利交易型开放式指数证券投资基金	资产管理人托管人关联方
中保投资基金有限公司	资产管理人托管人关联方
中银国际证券股份有限公司	资产管理人托管人关联方
营口港务集团有限公司	资产管理人托管人关联方
中广核一期产业投资基金有限公司	资产管理人托管人关联方
四川泸天化股份有限公司	资产管理人托管人关联方
优领环球有限公司	资产管理人托管人关联方
上海澄港置业有限公司	资产管理人托管人关联方
Wkland Investment II Limited	资产管理人托管人关联方
国家绿色发展基金股份有限公司	资产管理人托管人关联方
中银香港（控股）有限公司	资产管理人托管人关联方
中银香港（集团）有限公司	资产管理人托管人关联方
中银集团投资有限公司	资产管理人托管人关联方
中银集团人寿保险有限公司	资产管理人托管人关联方
中银金融资产投资有限公司	资产管理人托管人关联方
中银理财有限责任公司	资产管理人托管人关联方
中银金融科技有限公司	资产管理人托管人关联方
中银金融租赁有限公司	资产管理人托管人关联方
中银集团保险有限公司	资产管理人托管人关联方
中银基金管理有限公司	资产管理人托管人关联方
中银消费金融有限公司	资产管理人托管人关联方
中银富登村镇银行股份有限公司	资产管理人托管人关联方
中银三星人寿保险有限公司	资产管理人托管人关联方
中国银行（英国）有限公司	资产管理人托管人关联方
澳门大丰银行股份有限公司	资产管理人托管人关联方
中国银行（澳门）股份有限公司	资产管理人托管人关联方
国民养老保险股份有限公司	资产管理人托管人关联方
中银保险有限公司	资产管理人托管人关联方
中国银行股份有限公司深圳幸福支行	资产管理人托管人关联方

中银国际控股有限公司	资产管理人托管人关联方
富达中国成长股票 1 号单一资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
富达中国新经济主题单一资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
富达债券增强 1 号集合资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
富达沪深 300 指数增强单一资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
富达传承 6 个月持有期股票型证券投资基金	资产管理人管理的其它产品
富达蔚然 1 号 FOF 集合资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
富达裕达纯债债券型证券投资基金	资产管理人管理的其它产品
富达红利股票 1 号资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
富达 90 天持有期债券型证券投资基金	资产管理人管理的其它产品
富达悦享红利优选混合型证券投资基金	资产管理人管理的其它产品
富达天枢 1 号资产配置 FOF 集合资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
富达天枢 2 号行业轮动 FOF 集合资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
富达天枢 3 号股基增强 FOF 集合资产管理计划	资产管理人管理的其它产品
RAJEEV MITTAL	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
XIAOYI HELEN HUANG	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
JEFFREY PAUL LAGARCE	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
LIN ZHOU	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
邓漪励	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
李勇	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
管伊迪	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
陈星德	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
何湘	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员
燕江峰	资产管理人的董事、监事、高级管理人员、投资总监、管理该产品的投资人员

包赞	本资产管理计划投资经理
赵强	本资产管理计划投资经理

## 6.2 关联交易

### 6.2.1 资产管理计划通过关联方交易单元进行的股票交易

本计划本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

### 6.2.2 资产管理计划通过关联方交易单元进行的债券交易

本计划本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 6.2.3 资产管理计划通过关联方交易单元进行的债券回购交易

本计划本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 6.2.4 资产管理计划通过关联方交易单元进行的资产管理产品交易

本计划本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的资产管理产品交易。

### 6.2.5 资产管理计划在承销期内参与关联方承销证券的情况

本计划本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 6.2.6 资产管理计划投资于关联方管理的公募基金或私募资产管理计划的情况

本计划本报告期内未投资于关联方管理的公募基金或私募资产管理计划。

### 6.2.7 资产管理计划与关联方作为对手方进行交易买卖，或质押券涉及关联方的情况

本计划本报告期内未发生与关联方作为对手方进行交易买卖，或质押券涉及关联方的情况。

## 6.2.8 关联方报酬

### 6.2.8.1 管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的资产管理计划应支付的管理费	19,594.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,942.71
应支付资产管理人的净管理费	14,652.12
应支付投资顾问的投资顾问费（若有）	-

## 6.2.8.2 托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的资产管理计划应支付的托管费	526.67

## 6.2.8.3 销售服务费

无。

## 6.3 其他重大事项

根据《富达蔚然 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》约定，资产管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的，应向资产委托人充分披露。

截至 2024 年 6 月 30 日，本公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方持有份额占本计划总份额比例为 13.07%。

## § 7 影响资产委托人决策的其他重要信息

## § 8 免责声明

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供特定客户资产管理业务客户参考。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或删改，否则将构成侵权。投资有风险，请理性选择。资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托资产一定盈利，也不保证最低收益。本委托资产的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的其他资产的业绩也不构成本委托资产业绩表现的保证。本特定客户资产管理业务的具体情况以该产品法律文件为准，请详细阅读。

富达基金管理（中国）有限公司

2024年07月31日