

富安达睿选增利债券型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 29 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2024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2024年3月12日（基金合同生效日）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	7
§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	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达睿选增利债券型证券投资基金	
基金简称	富安达睿选增利债券	
基金主代码	019798	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年03月12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	62,774,212.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达睿选增利债券 A	富安达睿选增利债券 C
下属分级基金的交易代码	019798	019799
报告期末下属分级基金的份额总额	4,970,343.10份	57,803,869.53份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金管理人在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上，采用自上而下的富安达多维经济模型，运用定性与定量分析方法，通过对全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，判断和预测经济发展周期及趋势，构建和调整固定收益证券投资组合。</p> <p>本基金管理人将运用多策略进行债券资产组合的配置和投资。根据基本价值评估、经济环境和市场风险评估预期未来市场利率水平以及利率曲线形态确定债券组合的久期配置，在确定组合久期基础上进行组合期限配置形态的调整。通过对宏观经济、产业行业</p>

	的研究以及相应的财务分析和非财务分析，"自上而下"在各类债券资产类别之间进行类属配置，精选个券并严控信用风险。在市场收益率以及个券收益率变化过程中，灵活运用骑乘策略、回购策略等增强组合收益。
业绩比较基准	中债总财富（1-3年）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，预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于混合型基金、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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李理想	方圆
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道156 8号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		王胜	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	中国证券报
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 (2024年03月12日(基金合同生效日)-2024年06月30日)	
	富安达睿选增利债券A	富安达睿选增利债券C
本期已实现收益	218,430.74	351,790.39
本期利润	201,522.97	372,831.05
加权平均基金份额本期利润	0.0035	0.0029
本期加权平均净值利润率	0.35%	0.29%
本期基金份额净值增长率	0.16%	0.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-167.72	-19,246.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0000	-0.0003
期末基金资产净值	4,978,227.30	57,878,061.16
期末基金份额净值	1.00158625	1.00128351
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.16%	0.13%

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，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、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。

4、本基金《基金合同》生效日为2024年3月12日,截至本报告期末,基金成立未满1年。

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

富安达睿选增利债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.11%	0.03%	0.01%	0.05%	-0.12%	-0.02%
过去三个月	0.08%	0.03%	0.70%	0.07%	-0.62%	-0.04%
自基金合同生效起至今	0.16%	0.03%	0.77%	0.07%	-0.61%	-0.04%

富安达睿选增利债券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
过去一个月	-0.13%	0.03%	0.01%	0.05%	-0.14%	-0.02%
过去三个月	0.06%	0.03%	0.70%	0.07%	-0.64%	-0.04%
自基金合同生效起至今	0.13%	0.03%	0.77%	0.07%	-0.64%	-0.04%

注:

1. 本基金业绩比较基准为中债总财富(1-3年)指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

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:

$$\text{Return } t = [\text{中债总财富(1-3年)指数收益率}_t - \text{中债总财富(1-3年)指数收益率}(t-1)] \times 90\% + [\text{沪深300指数收益率}_t - \text{沪深300指数收益率}(t-1)] \times 10\%$$

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

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

富安达睿选增利债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年03月12日-2024年06月30日)



富安达睿选增利债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年03月12日-2024年06月30日)



注：①本基金《基金合同》生效日为2024年3月12日，截至本报告期末，基金成立未满1年。

②根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2024年9月11日。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§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2024年6月30日，公司共管理二十七只开放式基金：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、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达成长价值一年持有期混合型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达先进制造混合型发起式证券投资基金、富安达产业优选混合型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、富安达富祥利率债债券型证券投资基金、富安达富禧纯债30天持有期债券型证券投资基金、富安达睿选增利债券型证券投资基金、富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金。

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		

赵恒毅	本基金的基金经理、 固定收益部总监	2024- 03-22	-	19年	<p>硕士。历任通用技术集团投资有限公司资产管理部债券研究员；富国基金管理有限公司固定收益部债券研究员、债券基金经理；海富通基金管理有限公司债券基金经理、债券基金部副总监；中欧基金管理有限公司纯债专户部资深投资经理；益民基金副总经理兼固定收益部总监。2022年加入富安达基金管理有限公司，现任固定收益部总监、富安达稳健配置6个月持有期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、富安达睿选增利债券型证券投资基金的基金经理。</p>
康佳燕	本基金的基金经理、 固定收益部总监助理	2024- 03-12	-	18年	<p>硕士。历任工银安盛人寿保险有限公司财务部投资分析，泰信基金管理有限公司基金会计；浦银安盛基金管理有限公司基金会计、债券交易员、货币基金经理、专户投资经理；南洋商业银行固定收益部投资经理。2021年加入富安达基金管理有限公司任固定收益部总监助理。现任富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达现金货币市场证券投资基金、富安达中证同业存单</p>

					AAA指数7天持有期证券投资基金、富安达富祥利率债债券型证券投资基金、富安达富禧纯债30天持有期债券型证券投资基金、富安达睿选增利债券型证券投资基金的基金经理。
栾庆帅	本基金的基金经理	2024-03-12	-	16年	硕士。历任中山证券有限责任公司化工行业研究员；国民信托有限公司研究员。2013年加入富安达基金管理有限公司任高级行业研究员。现任富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达先进制造混合型发起式证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达成价值一年持有期混合型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达睿选增利债券型证券投资基金的基金经理。曾任富安达优势成长混合型证券投资基金、富安长达盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：

- 1.任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。
- 2.证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达睿选增利债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

上半年，国内经济开局良好，但在二季度经济增长速度有所放缓。具体而言，出口表现超预期，投资增速适中，消费增速中枢下移。近期，5、6两月PMI均在荣枯线以下，房地产市场销售同比仍下滑，不过在“517”地产新政后环比数据有所好转。债券市场总体呈现供不应求的格局，货币政策方面降准降息均有出台。受货币宽松预期和禁止手工补息影响，债券收益率普遍下行，信用利差和评级利差均显著压缩。股市方面波动较大，春节前股指出现调整，2-5月呈震荡回升走势，临近年中又有所调整。板块内部分化较大，整体上高股息、大盘价值表现较好，小盘股表现较差。转债走势基本与股指一致，估值经历了先压缩后扩张再压缩的过程。

本基金于3月中旬成立，4月中旬开放申购、赎回，初期主要投资于稳健性资产、中短期限高等级信用债。随后由于基金规模的波动，逐步减持信用债，之后少量参与了利率债交易，在4月下旬市场调整时净值有所波动。5月后，基金主要投资于低波动资产，以累积净值安全垫。权益部分参与很少，少量参与了转债交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达睿选增利债券A基金份额净值为1.00158625元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.16%，同期业绩比较基准收益率为0.77%；截至报告期末富安达睿选增利债券C基金份额净值为1.00128351元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.13%，同期业绩比较基准收益率为0.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年我国GDP同比增长5%，二季度环比一季度增长动能有所减弱。因此，为完成两会预定的全年经济增长目标，预计下半年可能会出台新的稳增长政策，发力点可能在财政政策和地产政策。货币政策方面仍有降准降息空间，但出台时机可能需要结合外部政策和国内发债节奏来判断。债券市场需求仍然旺盛，央行多次提示长债风险，预计债市波动加大，但调整风险可控。股市方面，在当前经济基本面下，预计更可能呈现震荡分化的走势，板块轮动较快，行业分化加剧。转债大体上跟随股市风格，不过当前较低的估值为投资者提供了一定保护。

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，估值委员会成员由公司总经理、督察长、首席信息官、基金经理、以及权益投资部、研究发展部、固定收益部、多资产投资部、监察稽核部和基金事务部负责人组成，公司其他高级管理人员可列席参会。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议；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，本基金曾存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

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睿选增利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《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睿选增利债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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睿选增利债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富安达睿选增利债券型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	10,695,806.49
结算备付金		21,546,659.31

存出保证金		7,311.21
交易性金融资产	6.4.7.2	13,833,867.82
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		13,833,867.82
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	17,303,891.40
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		499.70
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		63,388,035.93
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日
负债：		
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		-
应付清算款		402,237.22
应付赎回款		49,936.52
应付管理人报酬		14,490.19
应付托管费		2,898.05
应付销售服务费		4,753.66
应付投资顾问费		-
应交税费		410.70
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	57,021.13
负债合计		531,747.47
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	62,774,212.63
未分配利润	6.4.7.8	82,075.83
净资产合计		62,856,288.46
负债和净资产总计		63,388,035.93

注：报告截止日2024年6月30日，富安达睿选增利债券A份额净值1.00158625元，基金份额总额4,970,343.10份，富安达睿选增利债券C份额净值1.00128351元，基金份额总额57,803,869.53，总份额合计62,774,212.63份。

6.2 利润表

会计主体：富安达睿选增利债券型证券投资基金

本报告期：2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年03月12日（基金合同 生效日）至2024年06月30 日
一、营业总收入		1,035,872.01
1.利息收入		980,495.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	771,332.77
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		209,162.86
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		51,243.49
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,538.04
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	44,705.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,132.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		461,517.99
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	272,588.82
2.托管费	6.4.10.2.2	54,517.79
3.销售服务费	6.4.10.2.3	75,467.45
4.投资顾问费		-
5.利息支出		364.38
其中：卖出回购金融资产支出		364.38
6.信用减值损失	6.4.7.18	-
7.税金及附加		1,155.13
8.其他费用	6.4.7.19	57,424.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		574,354.02
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		574,354.02
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		574,354.02

6.3 净资产变动表

会计主体：富安达睿选增利债券型证券投资基金

本报告期：2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	448,268,723.28	-	448,268,723.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-385,494,510.65	82,075.83	-385,412,434.82
（一）、综合收益总额	-	574,354.02	574,354.02
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-385,494,510.65	-492,278.19	-385,986,788.84
其中：1.基金申购款	41,070,243.20	44,675.57	41,114,918.77
2.基金赎回款	-426,564,753.85	-536,953.76	-427,101,707.61
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	62,774,212.63	82,075.83	62,856,288.46

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：

王胜

孙爱民

王雪

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

富安达睿选增利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[2023]1333号《关于准予富安达睿选增利债券型证券投资基金注册的批复》注册，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《富安达睿选增利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448,100,364.53元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第2400254号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富安达睿选增利债券型证券投资基金基金合同》于2024年3月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为448,268,723.28份基金份额，其中认购资金利息折合168,358.75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《富安达睿选增利债券型证券投资基金基金合同》和《富安达睿选增利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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《富安达睿选增利债券型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，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（包括国债、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、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（以下简称“公募基金”，不包括QDII基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的基金、货币市场基金、非同一基金管理人管理的基金（股票型ETF除外））、国债期货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相关规定）。其中，对于公募基金投资，本基金仅投资于股票型ETF、本基金管理人管理的股票型基金和混合型基金，其中混合型基金需至少符合以下标准之一：1、基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于60%；2、基金最近四个季度定期报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于60%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其它的产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；本基金投资于股票、股票型ETF、股票型基金、混合型基金、可转换债券（含分离交易

可转债)、可交换债券的比例不高于基金资产的20%;本基金持有公募基金,其市值不超过基金资产净值的10%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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,前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,基金管理人在履行适当程序后以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为中债总财富(1-3年)指数收益率 \times 90%+沪深300指数收益率 \times 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“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<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2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要求,真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况、自2024年3月12日(基金合同生效日)至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2024年3月12日(基金合同生效日)至2024年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》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) 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，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。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；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。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，股权的股息、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。

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。

c) 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	694,073.15
等于：本金	694,010.55
加：应计利息	62.60
减：坏账准备	-
定期存款	10,001,733.34
等于：本金	10,000,000.00
加：应计利息	1,733.34
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	10,001,733.34
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	10,695,806.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,669,003.81	53,182.98	3,724,889.68	2,702.89
	银行间市场	10,019,570.00	87,978.14	10,108,978.14	1,430.00
	合计	13,688,573.81	141,161.12	13,833,867.82	4,132.89
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	13,688,573.81	141,161.12	13,833,867.82	4,132.89	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产 / 负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	17,303,891.40	-
银行间市场	-	-
合计	17,303,891.40	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,497.85
其中：交易所市场	947.85
银行间市场	5,550.00
应付利息	-
预提费用-审计费	12,896.50
预提费用-信息披露费	37,626.78
合计	57,021.13

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 富安达睿选增利债券A**

金额单位：人民币元

项目 (富安达睿选增利债券A)	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	159,078,966.17	159,078,966.17
本期申购	26,332.94	26,332.94
本期赎回（以“-”号填列）	-154,134,956.01	-154,134,956.01
本期末	4,970,343.10	4,970,343.10

6.4.7.7.2 富安达睿选增利债券C

金额单位：人民币元

项目 (富安达睿选增利债券C)	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	289,189,757.11	289,189,757.11
本期申购	41,043,910.26	41,043,910.26
本期赎回（以“-”号填列）	-272,429,797.84	-272,429,797.84
本期末	57,803,869.53	57,803,869.53

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 富安达睿选增利债券A

单位：人民币元

项目 (富安达睿选增利债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	218,430.74	-16,907.77	201,522.97
本期基金份额交易产生的变动数	-218,598.46	24,959.69	-193,638.77
其中：基金申购款	41.12	-5.33	35.79
基金赎回款	-218,639.58	24,965.02	-193,674.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-167.72	8,051.92	7,884.20

6.4.7.8.2 富安达睿选增利债券C

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

(富安达睿选增利债券 C)			
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	351,790.39	21,040.66	372,831.05
本期基金份额交易产 生的变动数	-371,037.25	72,397.83	-298,639.42
其中：基金申购款	-17,233.39	61,873.17	44,639.78
基金赎回款	-353,803.86	10,524.66	-343,279.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,246.86	93,438.49	74,191.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30 日
活期存款利息收入	5,652.99
定期存款利息收入	506,853.34
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	258,810.22
其他	16.22
合计	771,332.77

注：其他为存出保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30 日
卖出股票成交总额	639,377.00
减：卖出股票成本总额	631,490.00

减：交易费用	1,348.96
买卖股票差价收入	6,538.04

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年 06月30日
债券投资收益——利息收入	198,665.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-153,959.65
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	44,705.45

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	303,307,716.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	298,896,224.02
减：应计利息总额	4,559,573.66
减：交易费用	5,878.81
买卖债券差价收入	-153,959.65

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金在本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日
1.交易性金融资产	4,132.89
——股票投资	-
——债券投资	4,132.89
——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	4,132.89

6.4.7.17 其他收入

本基金在本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日
审计费用	12,896.50
信息披露费	37,626.78
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,501.14
其他	400.00
合计	57,424.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

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

本报告期内，关联方关系未发生变化。

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**

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
南京证券	97,703,258.90	60.72%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024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	265,700,000.00	26.92%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内没有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	272,588.82

其中：应支付销售机构的客户维护费	115,733.11
应支付基金管理人的净管理费	156,855.71

注：1、支付基金管理人富安达基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的基金资产净值后余额（若为负数，则取0）的0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人自身管理的其他基金所对应的基金资产净值后余额（若为负数，则取0） \times 0.5%/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
	2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	54,517.79

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扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金所对应的基金资产净值后余额（若为负数，则取0）的0.10%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扣除所持有本基金托管人自身托管的其他基金所对应的基金资产净值后余额（若为负数，则取0） \times 0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达睿选增利债券A	富安达睿选增利债券C	合计
交通银行	0.00	66,725.06	66,725.06
富安达基	0.00	341.51	341.51

金			
南京证券	0.00	7,903.58	7,903.58
合计	0.00	74,970.15	74,970.15

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.20%/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

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

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

本期末，除基金管理人之外的其他关联方均未发生投资本基金的情况。

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 2024年03月12日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	694,073.15	5,652.99

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2024年6月30日的相关余额为人民币1,836,565.93元。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2024年6月30日，本基金未持有因认购新发或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

于2024年6月30日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2024年6月30日，本基金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

于2024年6月30日，本基金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

于2024年6月30日，本基金未持有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

本基金是一只主动管理型债券型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金在控制风险和保持流动性的基础上，力争为基金

份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。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，运用理性分析价值，严格控制风险，通过积极的主动管理优化基金的风险与收益，为投资人带来长期稳定的回报。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日
--------	--------------------

A-1	-
A-1以下	-
未评级	13,466,431.16
合计	13,466,431.16

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日
AAA	367,436.66
AAA以下	-
未评级	-
合计	367,436.66

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2024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(净资产)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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%(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2024年6月30日，本基金无流动性受限资产。

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2024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未来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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	10,695,806.49	-	-	-	10,695,806.49
结算备 付金	21,546,659.31	-	-	-	21,546,659.31
存出保 证金	7,311.21	-	-	-	7,311.21
交易性 金融资 产	13,592,855.18	241,012.64	-	-	13,833,867.82
买入返 售金融 资产	17,303,891.40	-	-	-	17,303,891.40
应收申 购款	-	-	-	499.70	499.70
资产总 计	63,146,523.59	241,012.64	-	499.70	63,388,035.93
负债					
应付清 算款	-	-	-	402,237.22	402,237.22
应付赎 回款	-	-	-	49,936.52	49,936.52
应付管 理人报 酬	-	-	-	14,490.19	14,490.19
应付托 管费	-	-	-	2,898.05	2,898.05
应付销 售服务 费	-	-	-	4,753.66	4,753.66

应交税费	-	-	-	410.70	410.70
其他负债	-	-	-	57,021.13	57,021.13
负债总计	-	-	-	531,747.47	531,747.47
利率敏感度缺口	63,146,523.59	241,012.64	-	-531,247.77	62,856,288.46

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2024年06月30日
	1.市场利率下降25个基点	18,372.40
	2.市场利率上升25个基点	-18,308.10

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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日
第一层次	367,436.66
第二层次	13,466,431.16
第三层次	-
合计	13,833,867.82

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2024年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,833,867.82	21.82
	其中：债券	13,833,867.82	21.82
	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	17,303,891.40	27.30
	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	32,242,465.80	50.87
8	其他各项资产	7,810.91	0.01
9	合计	63,388,035.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	002558	巨人网络	361,190.00	0.57
2	002236	大华股份	270,300.00	0.43

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002558	巨人网络	365,351.00	0.58
2	002236	大华股份	274,026.00	0.44

注：“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。

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	631,490.00
卖出股票收入（成交）总额	639,377.00

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

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	3,357,453.02	5.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,108,978.14	16.08
	其中：政策性金融债	10,108,978.14	16.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	367,436.66	0.58
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	13,833,867.82	22.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	240301	24进出01	100,000	10,108,978.14	16.08
2	019727	23国债24	23,000	2,341,837.95	3.73
3	019709	23国债16	10,000	1,015,615.07	1.62
4	113052	兴业转债	1,300	140,682.97	0.22
5	113021	中信转债	1,070	126,424.02	0.20

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 本基金投资股指期货的投资政策

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，本基金投资的前十名证券的发行主体中，南京银行股份有限公司、中信银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

在本基金对该证券的投资过程中，本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下，经公司审慎研究评估，将该证券纳入投资库进行投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序。

7.12.2 本基金本报告期末未持有股票投资。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,311.21
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	499.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,810.91

7.12.4 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	113052	兴业转债	140,682.97	0.22
2	113021	中信转债	126,424.02	0.20
3	113050	南银转债	100,329.67	0.16

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
富安达睿选增利债券A	67	74,184.23	79,672.27	1.60%	4,890,670.83	98.40%
富安达睿选增利债券C	170	340,022.76	41,315,574.84	71.48%	16,488,294.69	28.52%
合计	237	264,870.10	41,395,247.11	65.94%	21,378,965.52	34.06%

注：基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资	富安达睿选增利债	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	券A	
	富安达睿选增利债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达睿选增利债券A	0
	富安达睿选增利债券C	0
	合计	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

	富安达睿选增利债券A	富安达睿选增利债券C
基金合同生效日(2024年03月12日)基金份额总额	159,078,966.17	289,189,757.11
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	26,332.94	41,043,910.26
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	154,134,956.01	272,429,797.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,970,343.10	57,803,869.53

§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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

东方 证券	1	-	-	-	-	-
东海 证券	1	-	-	-	-	-
方正 证券	1	-	-	-	-	-
光大 证券	1	-	-	-	-	-
国泰 君安	1	-	-	-	-	-
国信 证券	1	-	-	-	-	-
国元 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-
华创 证券	1	-	-	-	-	-
麦高 证券	1	-	-	-	-	-
申港 证券	1	-	-	-	-	-
五矿 证券	1	-	-	-	-	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
新时 代证 券	1	-	-	-	-	-
信达 证券	1	-	-	-	-	-
银河 证券	1	-	-	-	-	-

英大 证券	1	-	-	-	-	-
浙商 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中泰 证券	1	-	-	-	-	-
财通 证券	2	-	-	-	-	-
大同 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	1,270,867.00	100.0 0%	947.85	100.0 0%	-
东方 财富	2	-	-	-	-	-
东吴 证券	2	-	-	-	-	-
东兴 证券	2	-	-	-	-	-
东亚 前海 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国联 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-

华宝 证券	2	-	-	-	-	-
华金 证券	2	-	-	-	-	-
华龙 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
华源 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-
南京 证券	2	-	-	-	-	-
山西 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
首创 证券	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-

中信 证券	2	-	-	-	-	-
中银 国际 证券	2	-	-	-	-	-
上海 证券	3	-	-	-	-	-
招商 证券	3	-	-	-	-	-

注：

1、交易单元的选择标准和程序：

我公司制定了选择券商的标准，即：

(1) 财务状况良好，经营行为规范，具有完备的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 合规风控管理制度健全，具有良好的诚信合规记录，最近一年未因发生重大违规行为而受到证监会处罚；

(3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合基金证券交易的需要，最近一年未发生重大信息安全事故；

(4) 能为公司提供高质量的研究服务；

基金管理人会对潜在签约券商进行必要的尽职调查，将相应的交易单元租用协议等作为附件，发起相应OA审批流程，经审批后用印。

2、在上述租用的券商交易单元中，(59740)德邦证券、(59593、396732)华源证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：(391893)东方证券、(39632)中信建投。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	30,600,000.00	3.10%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	7,424,237.39	4.61%	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	15,315,900.00	9.52%	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

民生证券	13,372,283.14	8.31%	294,000,000.00	29.78%	-	-	-	-
南京证券	97,703,258.90	60.72%	265,700,000.00	26.92%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	3,644,773.03	2.26%	79,000,000.00	8.00%	-	-	-	-
招商证券	23,459,942.70	14.58%	317,800,000.00	32.20%	-	-	-	-

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	关于富安达睿选增利债券型证券投资基金新增国信证券股份有限公司为发售机构的公告	规定媒介	2024-01-20
2	关于富安达睿选增利债券型证券投资基金新增交通银行股份有限公司为发售机构的公告	规定媒介	2024-02-06
3	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加乾道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	2024-02-06
4	富安达睿选增利债券型证券投资基金提前结束募集的公告	规定媒介	2024-03-01

5	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2024-03-05
6	富安达睿选增利债券型证券投资基金基金合同生效公告	规定媒介	2024-03-13
7	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加众惠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	2024-03-13
8	富安达睿选增利债券型证券投资基金基金经理变更公告	规定媒介	2024-03-23
9	富安达睿选增利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2024-03-26
10	富安达睿选增利债券型证券投资基金招募说明书	规定媒介	2024-03-26
11	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-03-28
12	富安达睿选增利债券型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	规定媒介	2024-04-11
13	富安达基金管理有限公司关于提高富安达睿选增利债券型证券投资基金份额净值精度的公告	规定媒介	2024-04-18
14	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	2024-05-09
15	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的	规定媒介	2024-05-30

	公告		
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	2024-06-13
17	富安达睿选增利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2024-06-26
18	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	2024-06-27
19	富安达基金管理有限公司关于变更直销柜台汇款交易业务银行账户的公告	规定媒介	2024-06-28

§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	20240627-20240630	0.00	20,806,834.50	-	20,806,834.50	33.15%
	2	20240626-20240630	0.00	19,978,564.00	-	19,978,564.00	31.83%
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。							

注：

- ①"申购份额"包含份额申购、转换转入、红利再投等导致份额增加的情况；
- ②"赎回份额"包含份额赎回、转换转出等导致份额减少的情况。

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睿选增利债券型证券投资基金设立的文件：

《富安达睿选增利债券型证券投资基金招募说明书》；

《富安达睿选增利债券型证券投资基金基金合同》；

《富安达睿选增利债券型证券投资基金托管协议》。

2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

3、基金管理人业务资格批件和营业执照；

4、基金托管人业务资格批件和营业执照；

5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.fadfunds.com）查阅。

富安达基金管理有限公司

二〇二四年八月二十九日