

# **富安达富祥利率债债券型证券投资基金**

## **2026 年中期报告**

2026 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:上海银行股份有限公司

送出日期:2026 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026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2026年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

|                                               |    |
|-----------------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录 .....                              | 2  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2  |
| 1.2 目录 .....                                  | 3  |
| §2 基金简介 .....                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 .....                        | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 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 .....                 | 12 |
| 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 .....             | 13 |
| 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 .....       | 14 |
| §5 托管人报告 .....                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 14 |
| 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 ..... | 14 |
| 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 .....                                | 20 |
| §7 投资组合报告 .....                               | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 42 |
| 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 .....       | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 43 |
| 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 .....      | 44 |
| 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 .....   | 44 |
| 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 .....   | 44 |
| 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 .....      | 44 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                     | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....               | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                           | 44 |
| §8 基金份额持有人信息 .....                            | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                   | 45 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 46 |
| 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 .....   | 46 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 47 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 48 |
| 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 .....   | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 48 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 48 |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 49 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 50 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 52 |
| 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 ..... | 52 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 53 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 53 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 53 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 53 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 53 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                   |                |           |
|-----------------|-------------------|----------------|-----------|
| 基金名称            | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金 |                |           |
| 基金简称            | 富安达富祥利率债          |                |           |
| 基金主代码           | 018450            |                |           |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |                |           |
| 基金合同生效日         | 2023年07月27日       |                |           |
| 基金管理人           | 富安达基金管理有限公司       |                |           |
| 基金托管人           | 上海银行股份有限公司        |                |           |
| 报告期末基金份额总额      | 1,237,268,227.61份 |                |           |
| 基金合同存续期         | 不定期               |                |           |
| 下属分级基金的基金简称     | 富安达富祥利率债A         | 富安达富祥利率债C      | 富安达富祥利率债D |
| 下属分级基金的交易代码     | 018450            | 018451         | 023557    |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,187,247,033.62份 | 50,021,193.99份 | 0.00份     |

注：本基金自2025年3月5日起新增D类份额。

2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。                                                                                                                                                                                                             |
| 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</p> |

|        |                                                                                               |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 合期限配置形态的调整。通过对宏观经济运行的分析，"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。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-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率                                                                       |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。                                                 |

## 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          | 上海银行股份有限公司               |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李理想                  | 周直毅                      |
|         | 联系电话 | 021-61870999         | 021-68475608             |
|         | 电子邮箱 | service@fadfunds.com | custody@bosc.cn          |
| 客户服务电话  |      | 400-630-6999         | 95594                    |
| 传真      |      | 021-61870888         | 021-68476901             |
| 注册地址    |      | 上海市浦东新区世纪大道1568号29楼  | 上海市黄浦区中山南路688号           |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区世纪大道1568号29楼  | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号37层 |
| 邮政编码    |      | 200122               | 200120                   |
| 法定代表人   |      | 王胜                   | 顾建忠                      |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                  |
|-------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 上海证券报            |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.fadfunds.com |
| 基金中期报告置备地点        | 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<br>(2026年01月01日-2026年06月30日) |               |               |
|---------------|----------------------------------|---------------|---------------|
|               | 富安达富祥<br>利率债A                    | 富安达富祥<br>利率债C | 富安达富祥<br>利率债D |
| 本期已实现收益       | 9,345,338.68                     | 239,817.57    | -             |
| 本期利润          | 13,197,003.08                    | 361,417.07    | -             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0162                           | 0.0172        | -             |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.60%                            | 1.70%         | -             |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.59%                            | 1.46%         | 1.59%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2026年06月30日)            |               |               |
|               | 富安达富祥<br>利率债A                    | 富安达富祥<br>利率债C | 富安达富祥<br>利率债D |
| 期末可供分配利润      | 14,955,311.53                    | 750,868.99    | -             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0126                           | 0.0150        | -             |
| 期末基金资产净值      | 1,202,202,345.15                 | 50,778,666.95 | -             |
| 期末基金份额净值      | 1.0126                           | 1.0151        | 1.0126        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2026年06月30日)            |               |               |
|               | 富安达富祥<br>利率债A                    | 富安达富祥<br>利率债C | 富安达富祥<br>利率债D |
| 基金份额累计净值增长率   | 8.56%                            | 8.79%         | 1.76%         |

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、本基金自2025年3月5日起新增D类份额。本报告期末,本基金D类份额余额为0。D类份额余额为0期间,以A类份额净值作为D类份额参考净值。

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

富安达富祥利率债A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 0.83%        | 0.04%               | 0.62%              | 0.06%                     | 0.21% | -0.02% |
| 过去六个月          | 1.59%        | 0.04%               | 0.89%              | 0.06%                     | 0.70% | -0.02% |
| 过去一年           | 1.05%        | 0.06%               | -0.45%             | 0.07%                     | 1.50% | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 8.56%        | 0.07%               | 5.10%              | 0.10%                     | 3.46% | -0.03% |

富安达富祥利率债C

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 0.73%        | 0.04%               | 0.62%              | 0.06%                     | 0.11% | -0.02% |
| 过去六个月          | 1.46%        | 0.04%               | 0.89%              | 0.06%                     | 0.57% | -0.02% |
| 过去一年           | 0.87%        | 0.06%               | -0.45%             | 0.07%                     | 1.32% | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 8.79%        | 0.07%               | 5.10%              | 0.10%                     | 3.69% | -0.03% |

富安达富祥利率债D

| 阶段 | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------------|---------------------|--------------------|----------------------|-----|-----|
|----|--------------|---------------------|--------------------|----------------------|-----|-----|



|            |       |       |        | ④     |       |        |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去三个月      | 0.83% | 0.04% | 0.62%  | 0.06% | 0.21% | -0.02% |
| 过去六个月      | 1.59% | 0.04% | 0.89%  | 0.06% | 0.70% | -0.02% |
| 过去一年       | 1.05% | 0.06% | -0.45% | 0.07% | 1.50% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.76% | 0.07% | -0.24% | 0.09% | 2.00% | -0.02% |

注：

- 1. 本基金业绩比较基准为中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率
- 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：  
 $Return\ t = 中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率t \div 中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率(t-1) - 1$   
 $Benchmark\ t = (1 + Return\ t) \times Benchmark(t-1)$   
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日。
- 3. 本基金自2025年3月5日起新增D类份额。本报告期末，本基金D类份额余额为0。D类份额余额为0期间，以A类份额净值作为D类份额参考净值。

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



富安达富祥利率债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  
(2023年07月27日-2026年06月30日)



富安达富祥利率债D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2025年03月05日-2026年06月30日)



注：本基金自2025年3月5日起新增D类份额。本报告期末，本基金D类份额余额为0。D类份额余额为0期间，以A类份额净值作为D类份额参考净值。

## §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2026年6月30日，公司共管理二十七只公开募集证券投资基金。

#### 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                    |
| 康佳燕 | 本基金的基金经理、固定收益部总监助理 | 2023-07-27      | -    | 20年    | 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，现任固定收益部总监助理、富安达富利纯债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、富安达富祥利率债债券型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金的基金经理。曾任富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达 |

|  |  |  |  |  |                                                                      |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、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。 |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------|

注：

- 1.基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；
- 2.证券从业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》中关于证券投资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合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达富祥利率债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

上半年国内债券市场整体向好，收益率整体走低。市场资金充裕，资金利率维持在利率走廊低位，债券收益率下行，中短端利率降幅更大，长端同步回落，超长端利率变化不大。二季度，央行通过公开市场操作，推动资金利率向政策利率靠拢，债市出现短期回调。受益于利率债供给减少，央行收窄利率走廊、落地隔夜逆回购工具，债市收益率再度下行。这一阶段中短端受资金面约束下行空间有限，长端也未突破关键点位，机构主要围绕压缩超长端利差开展操作。

报告期内，本基金主要配置利率债。本基金将继续秉承稳健专业的投资理念，谨慎操作、严格风控，力争为基金份额持有人带来长期稳定回报。同时，密切关注经济基本面、流动性、相关政策边际变化带来的投资机会，根据利率曲线结构进行调仓、波段及骑乘交易，争取增厚组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达富祥利率债A基金份额净值为1.0126元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.59%，同期业绩比较基准收益率为0.89%；截至报告期末富安达富祥利率债C基金份额净值为1.0151元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.46%，同期业绩比较基准收益率为0.89%；截至报告期末富安达富祥利率债D基金份额净值为1.0126元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.59%，同期业绩比较基准收益率为0.89%。本报告期末，本基金D类份额余额为0。D类份额余额为0期间，以A类份额净值作为D类份额参考净值。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年国内经济开局良好，上半年经济增速4.7%。一季度政策靠前发力，二季度对投资支持有所减弱，地产、消费、投资偏弱，出口高增，内需提振动力不足。从中央政治局会议导向看，逆周期政策将加大力度，存量政策加快落地，同时研究出台增量政策；预计三季度财政支出与发债节奏提速，货币政策灵活调整。

海外方面，美联储连续五次维持利率不变；中东局势动荡，霍尔木兹海峡通航反复，油价高位震荡。美国通胀仍有压力，约束其货币政策。沃什上任后美联储政策框架出现调整，后续政策取向与市场沟通存在不确定性，市场逻辑也随之变化。

展望下半年，为完成全年经济目标，在维持出口韧性的同时，提振内需、稳投资十分关键。存量财政政策加快落地、货币政策加大宽松的可能性上升。债市大概率延续上半年运行逻辑，但经过前期收益率下行、利差压缩后，进一步下行空间有限。中短端利率需关注资金利率，超长端除利差压缩外，还需要关注供给变化。

#### 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

本基金本报告期内共进行1次利润分配。于2026年5月7日公告本基金进行收益分配：每10份分红0.1元，共计分配利润8,706,677.96元。

#### 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：富安达富祥利率债债券型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|----------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产：     |         |                    |                     |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 2,652,025.34       | 1,310,584.15        |
| 结算备付金    |         | 14,174.92          | 58,983.02           |
| 存出保证金    |         | 1,847.49           | 1,717.00            |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 1,207,218,919.34   | 401,417,276.17      |
| 其中：股票投资  |         | -                  | -                   |
| 基金投资     |         | -                  | -                   |
| 债券投资     |         | 1,207,218,919.34   | 401,417,276.17      |
| 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 | 43,605,199.90      | 175,052,125.68      |
| 应收清算款    |         | -                  | -                   |
| 应收股利     |         | -                  | -                   |
| 应收申购款    |         | 27,020.00          | 70.00               |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 1,253,519,186.99           | 577,840,756.02              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2025年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | 39,494.35                  | 1,911.59                    |
| 应付管理人报酬       |            | 299,148.82                 | 103,744.14                  |
| 应付托管费         |            | 99,716.27                  | 34,581.39                   |
| 应付销售服务费       |            | 2,126.02                   | 292.69                      |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 2,325.12                   | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 95,364.31                  | 63,298.90                   |
| 负债合计          |            | 538,174.89                 | 203,828.71                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 1,237,268,227.61           | 573,613,873.21              |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 15,712,784.49              | 4,023,054.10                |
| 净资产合计         |            | 1,252,981,012.10           | 577,636,927.31              |
| 负债和净资产总计      |            | 1,253,519,186.99           | 577,840,756.02              |

注：报告截止日2026年6月30日，富安达富祥利率债债券型证券投资基金A份额净值1.0126元，基金份额总额1,187,247,033.62份，富安达富祥利率债债券型证券投资基金C份额净值1.0151元，基金份额总额50,021,193.99份，富安达富祥利率债债券型证券投资基金D份额净值1.0126元，基金份额余额为0.00份。总份额合计1,237,268,227.61份。



6.2 利润表

会计主体：富安达富祥利率债债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                       | 附注号      | 本期<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至202<br>5年06月30日 |
|---------------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入                   |          | 15,525,713.20                     | 4,562,593.32                           |
| 1.利息收入                    |          | 122,375.00                        | 477,094.40                             |
| 其中：存款利息收入                 | 6.4.7.9  | 60,823.67                         | 45,221.35                              |
| 债券利息收入                    |          | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息<br>收入            |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产<br>收入            |          | 61,551.33                         | 431,873.05                             |
| 其他利息收入                    |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”<br>填列）      |          | 11,430,042.80                     | 13,642,891.63                          |
| 其中：股票投资收益                 | 6.4.7.10 | -                                 | -                                      |
| 基金投资收益                    | 6.4.7.11 | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益                    | 6.4.7.12 | 11,430,042.80                     | 13,642,891.63                          |
| 资产支持证券投资<br>收益            | 6.4.7.13 | -                                 | -                                      |
| 贵金属投资收益                   | 6.4.7.14 | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益                    | 6.4.7.15 | -                                 | -                                      |
| 股利收益                      | 6.4.7.16 | -                                 | -                                      |
| 其他投资收益                    |          | -                                 | -                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失<br>以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 3,973,263.90                      | -9,557,414.28                          |
| 4.汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）     |          | -                                 | -                                      |
| 5.其他收入（损失以“-”             | 6.4.7.18 | 31.50                             | 21.57                                  |

|                     |            |               |              |
|---------------------|------------|---------------|--------------|
| 号填列)                |            |               |              |
| 减：二、营业总支出           |            | 1,967,293.05  | 1,347,848.71 |
| 1.管理人报酬             | 6.4.10.2.1 | 1,250,374.34  | 822,934.91   |
| 2.托管费               | 6.4.10.2.2 | 416,791.40    | 274,311.56   |
| 3.销售服务费             | 6.4.10.2.3 | 10,943.23     | 19,464.90    |
| 4.投资顾问费             |            | -             | -            |
| 5.利息支出              |            | 180,828.83    | 134,552.25   |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 180,828.83    | 134,552.25   |
| 6.信用减值损失            | 6.4.7.19   | -             | -            |
| 7.税金及附加             |            | 357.07        | -            |
| 8.其他费用              | 6.4.7.20   | 107,998.18    | 96,585.09    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 13,558,420.15 | 3,214,744.61 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 13,558,420.15 | 3,214,744.61 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -             | -            |
| 六、综合收益总额            |            | 13,558,420.15 | 3,214,744.61 |

6.3 净资产变动表

会计主体：富安达富祥利率债债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目       | 本期<br>2026年01月01日至2026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 | 573,613,873.21                | 4,023,054.10 | 577,636,927.31 |
| 二、本期期初净资产 | 573,613,873.21                | 4,023,054.10 | 577,636,927.31 |

|                                          |                                    |               |                  |
|------------------------------------------|------------------------------------|---------------|------------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 663,654,354.40                     | 11,689,730.39 | 675,344,084.79   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 13,558,420.15 | 13,558,420.15    |
| （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）      | 663,654,354.40                     | 6,837,988.20  | 670,492,342.60   |
| 其中：1.基金申购款                               | 1,111,065,350.13                   | 11,692,315.75 | 1,122,757,665.88 |
| 2.基金赎回款                                  | -447,410,995.73                    | -4,854,327.55 | -452,265,323.28  |
| （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） | -                                  | -8,706,677.96 | -8,706,677.96    |
| 四、本期期末净资产                                | 1,237,268,227.61                   | 15,712,784.49 | 1,252,981,012.10 |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025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                                | 552,838,699.33                     | 34,589,412.90 | 587,428,112.23   |
| 二、本期期初净资产                                | 552,838,699.33                     | 34,589,412.90 | 587,428,112.23   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 327,327,568.06                     | 13,015,581.66 | 340,343,149.72   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 3,214,744.61  | 3,214,744.61     |
| （二）、本期基金                                 | 327,327,568.06                     | 14,316,257.36 | 341,643,825.42   |

|                                          |                  |                |                  |
|------------------------------------------|------------------|----------------|------------------|
| 份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）              |                  |                |                  |
| 其中：1.基金申购款                               | 1,040,943,424.61 | 56,059,707.56  | 1,097,003,132.17 |
| 2.基金赎回款                                  | -713,615,856.55  | -41,743,450.20 | -755,359,306.75  |
| （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） | -                | -4,515,420.31  | -4,515,420.31    |
| 四、本期期末净资产                                | 880,166,267.39   | 47,604,994.56  | 927,771,261.95   |

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

富安达富祥利率债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]740号《关于准予富安达富祥利率债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《富安达富祥利率债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1,001,312,485.89元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字（2023）第0399号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富安达富祥利率债债券型证券投资基金基金合同》于2023年7月27日生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,001,312,517.53份基金份额，其中认购资金利息折合31.64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，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《富安达基金管理有限公司关于富安达富祥利率债债券型证券投资基金增设D类基金份额并修订基金合同和托管协议的公告》，自2025年3月5日（含当日）起，本基

金在现有基金份额的基础上增设D类基金份额。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，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购/申购基金时不收取认购费/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，根据销售服务费率的不同，分为C类基金份额、D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《富安达富祥利率债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，包括利率债（包括国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债券）、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、现金等货币市场工具、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）。本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券、可交换债券和信用债。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

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%，其中投资于利率债资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债-国债及政策性银行债全价（总值）指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。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《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 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2026年6月30日的财务状况、2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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》、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号文《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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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，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<br>2026年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 2,652,025.34       |
| 等于：本金        | 2,651,775.35       |
| 加：应计利息       | 249.99             |
| 减：坏账准备       | -                  |
| 定期存款         | -                  |
| 等于：本金        | -                  |
| 加：应计利息       | -                  |
| 减：坏账准备       | -                  |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                  |
| 存款期限1-3个月    | -                  |
| 存款期限3个月以上    | -                  |
| 其他存款         | -                  |
| 等于：本金        | -                  |
| 加：应计利息       | -                  |
| 减：坏账准备       | -                  |
| 合计           | 2,652,025.34       |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2026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 交易所市场       | -                  | -    | -    | -      |

|        |       |                  |               |                  |             |
|--------|-------|------------------|---------------|------------------|-------------|
| 券      | 银行间市场 | 1,184,471,662.40 | 22,967,919.34 | 1,207,218,919.34 | -220,662.40 |
|        | 合计    | 1,184,471,662.40 | 22,967,919.34 | 1,207,218,919.34 | -220,662.40 |
| 资产支持证券 |       | -                | -             | -                | -           |
| 基金     |       | -                | -             | -                | -           |
| 其他     |       | -                | -             | -                | -           |
| 合计     |       | 1,184,471,662.40 | 22,967,919.34 | 1,207,218,919.34 | -220,662.40 |

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<br>2026年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                  | -         |
| 银行间市场 | 43,605,199.90      | -         |
| 合计    | 43,605,199.90      | -         |

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<br>2026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      | 11,061.75 |
| 其中：交易所市场    | -         |
| 银行间市场       | 11,061.75 |
| 应付利息        | -         |
| 应付审计费       | 24,795.19 |
| 应付信息披露费     | 59,507.37 |
| 合计          | 95,364.31 |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 富安达富祥利率债A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(富安达富祥利率债A) | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                  |
|-------------------|-------------------------------|------------------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额             |
| 上年度末              | 523,412,940.27                | 523,412,940.27   |
| 本期申购              | 951,413,623.31                | 951,413,623.31   |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -287,579,529.96               | -287,579,529.96  |
| 本期末               | 1,187,247,033.62              | 1,187,247,033.62 |

6.4.7.7.2 富安达富祥利率债C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(富安达富祥利率债C) | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                 |
|-------------------|-------------------------------|-----------------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额            |
| 上年度末              | 50,200,932.94                 | 50,200,932.94   |
| 本期申购              | 159,651,726.82                | 159,651,726.82  |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -159,831,465.77               | -159,831,465.77 |
| 本期末               | 50,021,193.99                 | 50,021,193.99   |

6.4.7.7.3 富安达富祥利率债D

金额单位：人民币元

| 项目<br>(富安达富祥利率债D) | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |      |
|-------------------|-------------------------------|------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额 |
| 上年度末              | -                             | -    |
| 本期申购              | -                             | -    |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -                             | -    |
| 本期末               | -                             | -    |

注：申购含红利再投、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 富安达富祥利率债A

单位：人民币元

| 项目<br>(富安达富祥利率债A) | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|-------------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末              | 6,134,779.25  | -2,634,393.23 | 3,500,386.02  |
| 本期期初              | 6,134,779.25  | -2,634,393.23 | 3,500,386.02  |
| 本期利润              | 9,345,338.68  | 3,851,664.40  | 13,197,003.08 |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | 8,122,906.49  | -1,371,071.84 | 6,751,834.65  |
| 其中：基金申购款          | 11,455,505.69 | -2,267,155.56 | 9,188,350.13  |
| 基金赎回款             | -3,332,599.20 | 896,083.72    | -2,436,515.48 |
| 本期已分配利润           | -8,493,912.22 | -             | -8,493,912.22 |
| 本期末               | 15,109,112.20 | -153,800.67   | 14,955,311.53 |

6.4.7.8.2 富安达富祥利率债C

单位：人民币元

| 项目<br>(富安达富祥利率债C) | 已实现部分      | 未实现部分       | 未分配利润合计    |
|-------------------|------------|-------------|------------|
| 上年度末              | 761,278.33 | -238,610.25 | 522,668.08 |
| 本期期初              | 761,278.33 | -238,610.25 | 522,668.08 |

|                |               |             |               |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 本期利润           | 239,817.57    | 121,599.50  | 361,417.07    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -37,461.17    | 123,614.72  | 86,153.55     |
| 其中：基金申购款       | 2,853,745.52  | -349,779.90 | 2,503,965.62  |
| 基金赎回款          | -2,891,206.69 | 473,394.62  | -2,417,812.07 |
| 本期已分配利润        | -212,765.74   | -           | -212,765.74   |
| 本期末            | 750,868.99    | 6,603.97    | 757,472.96    |

6.4.7.8.3 富安达富祥利率债D

单位：人民币元

| 项目<br>(富安达富祥利率债D) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-------------------|-------|-------|---------|
| 上年度末              | -     | -     | -       |
| 本期期初              | -     | -     | -       |
| 本期利润              | -     | -     | -       |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | -     | -     | -       |
| 其中：基金申购款          | -     | -     | -       |
| 基金赎回款             | -     | -     | -       |
| 本期已分配利润           | -     | -     | -       |
| 本期末               | -     | -     | -       |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 12,748.49                     |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | -                             |
| 结算备付金利息收入 | 48,069.82                     |
| 其他        | 5.36                          |
| 合计        | 60,823.67                     |

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

本基金在本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金在本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 12,177,041.70                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -746,998.90                   |
| 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                           | 11,430,042.80                 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 306,454,660.42                |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 301,762,123.90                |
| 减：应计利息总额               | 5,429,010.42                  |
| 减：交易费用                 | 10,525.00                     |
| 买卖债券差价收入               | -746,998.90                   |

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金在本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 3,973,263.90                  |
| ——股票投资                 | -                             |
| ——债券投资                 | 3,973,263.90                  |
| ——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                     | 3,973,263.90                  |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2026年01月01日至2026年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 31.50                   |
| 合计      | 31.50                   |

**6.4.7.19 信用减值损失**

本基金在本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2026年01月01日至2026年06月30日 |
| 审计费用    | 24,795.19               |
| 信息披露费   | 59,507.37               |
| 证券出借违约金 | -                       |
| 银行汇划手续费 | 5,095.62                |
| 账户维护费   | 18,000.00               |
| 其他      | 600.00                  |
| 合计      | 107,998.18              |

**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**

截至本财务报告批准报出日，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、关联关系**

**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、关联关系未发生变化。

**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 |
| 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       |
| 上海银行股份有限公司("上海银行")   | 基金托管人、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及上年度可比期间均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及上年度可比期间均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                      |                | 上年度可比期间                 |                |
|-------|-------------------------|----------------|-------------------------|----------------|
|       | 2026年01月01日至2026年06月30日 |                | 2025年01月01日至2025年06月30日 |                |
|       | 成交金额                    | 占当期债券买卖成交总额的比例 | 成交金额                    | 占当期债券买卖成交总额的比例 |
| 南京证券  | 9,000,930.00            | 100.00%        | 1,900,228.00            | 100.00%        |

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,250,374.34                  | 822,934.91                         |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 58,160.48                     | 71,418.42                          |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,192,213.86                  | 751,516.49                         |

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0.30%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×0.30%/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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 416,791.40                    | 274,311.56                         |

注：支付基金托管人上海银行的基金托管费按前一日基金资产净值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×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<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |               |               |      |
|----------------------------|-------------------------------|---------------|---------------|------|
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费              |               |               |      |
|                            | 富安达富祥利率债<br>A                 | 富安达富祥利率债<br>C | 富安达富祥利率债<br>D | 合计   |
|                            | 富安达基                          | 0.00          | 547.91        | 0.00 |



|                            |                                    |               |               |          |
|----------------------------|------------------------------------|---------------|---------------|----------|
| 金                          |                                    |               |               |          |
| 南京证券                       | 0.00                               | 493.31        | 0.00          | 493.31   |
| 合计                         | 0.00                               | 1,041.22      | 0.00          | 1,041.22 |
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |               |               |          |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |               |               |          |
|                            | 富安达富祥利率债<br>A                      | 富安达富祥利率债<br>C | 富安达富祥利率债<br>D | 合计       |
| 富安达基金                      | 0.00                               | 7,634.40      | 0.00          | 7,634.40 |
| 南京证券                       | 0.00                               | 268.01        | 0.00          | 268.01   |
| 合计                         | 0.00                               | 7,902.41      | 0.00          | 7,902.41 |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.1%。根据《富安达基金管理有限公司关于富安达富祥利率债债券型证券投资基金增设D类基金份额并修订基金合同和托管协议的公告》，自2025年3月5日起，本基金增设D类基金份额，约定的销售服务费年费率为0.40%。支付基金销售机构的销售服务费按前一日C/D类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，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/D类基金份额前一日基金资产净值×约定年费率/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(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及上年度可比期间均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及上年度可比期间均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

本报告期内及上年度可比期间，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

本期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未发生投资富安达富祥利率债的情况。

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                      |           | 上年度可比期间                 |           |
|-------|-------------------------|-----------|-------------------------|-----------|
|       | 2026年01月01日至2026年06月30日 |           | 2025年01月01日至2025年06月30日 |           |
|       | 期末余额                    | 当期利息收入    | 期末余额                    | 当期利息收入    |
| 上海银行  | 2,652,025.34            | 12,748.49 | 430,723.59              | 13,369.81 |

注：本基金通过“上海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2026年6月30日的相关余额为人民币0元。（2025年6月30日：人民币0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及上年度可比期间均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

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

富安达富祥利率债A

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日        | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额     | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计     | 备注 |
|----|------------|------------|-------------|--------------|-----------|--------------|----|
| 1  | 2026-05-07 | 2026-05-07 | 0.100       | 8,493,418.98 | 493.24    | 8,493,912.22 | -  |

|    |  |  |       |              |        |              |   |
|----|--|--|-------|--------------|--------|--------------|---|
| 合计 |  |  | 0.100 | 8,493,418.98 | 493.24 | 8,493,912.22 | - |
|----|--|--|-------|--------------|--------|--------------|---|

富安达富祥利率债C

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日  | 除息日        | 每10份基金<br>份额分红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|-----------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 1  | 2026-05-07 | 2026-05-07 | 0.100           | 5,660.11     | 207,105.63    | 212,765.74   | -  |
| 合计 |            |            | 0.100           | 5,660.11     | 207,105.63    | 212,765.74   | -  |

注：本基金D类基金份额为0。

6.4.12 期末（2026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2026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2026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2026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2026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2026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，预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。本基金在控制风险和保持流动性的基础上，通过积

极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。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上海银行，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。

于2026年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2025年12月31日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2026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2026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2026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<br>2026年0<br>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<br>金               | 2,652,025.34   | -              | -              | -         | 2,652,025.34     |
| 结算备<br>付金              | 14,174.92      | -              | -              | -         | 14,174.92        |
| 存出保<br>证金              | 1,847.49       | -              | -              | -         | 1,847.49         |
| 交易性<br>金融资<br>产        | 71,006,873.98  | 670,421,317.81 | 465,790,727.55 | -         | 1,207,218,919.34 |
| 买入返<br>售金融<br>资产       | 43,605,199.90  | -              | -              | -         | 43,605,199.90    |
| 应收申<br>购款              | -              | -              | -              | 27,020.00 | 27,020.00        |
| 资产总                    | 117,280,121.63 | 670,421,317.81 | 465,790,727.55 | 27,020.00 | 1,253,519,186.99 |

|                     |                |                |                |             |                  |
|---------------------|----------------|----------------|----------------|-------------|------------------|
| 计                   |                |                |                |             |                  |
| 负债                  |                |                |                |             |                  |
| 应付赎回款               | -              | -              | -              | 39,494.35   | 39,494.35        |
| 应付管理人报酬             | -              | -              | -              | 299,148.82  | 299,148.82       |
| 应付托管费               | -              | -              | -              | 99,716.27   | 99,716.27        |
| 应付销售服务费             | -              | -              | -              | 2,126.02    | 2,126.02         |
| 应交税费                | -              | -              | -              | 2,325.12    | 2,325.12         |
| 其他负债                | -              | -              | -              | 95,364.31   | 95,364.31        |
| 负债总计                | -              | -              | -              | 538,174.89  | 538,174.89       |
| 利率敏感度缺口             | 117,280,121.63 | 670,421,317.81 | 465,790,727.55 | -511,154.89 | 1,252,981,012.10 |
| 上年度末<br>2025年12月31日 | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上           | 不计息         | 合计               |
| 资产                  |                |                |                |             |                  |
| 货币资金                | 1,310,584.15   | -              | -              | -           | 1,310,584.15     |
| 结算备付金               | 58,983.02      | -              | -              | -           | 58,983.02        |
| 存出保证金               | 1,717.00       | -              | -              | -           | 1,717.00         |
| 交易性金融资产             | 64,350,824.11  | 264,673,493.15 | 72,392,958.91  | -           | 401,417,276.17   |
| 买入返                 | 175,052,125.68 | -              | -              | -           | 175,052,125.68   |

|         |                |                |               |             |                |
|---------|----------------|----------------|---------------|-------------|----------------|
| 售金融资产   |                |                |               |             |                |
| 应收申购款   | -              | -              | -             | 70.00       | 70.00          |
| 资产总计    | 240,774,233.96 | 264,673,493.15 | 72,392,958.91 | 70.00       | 577,840,756.02 |
| 负债      |                |                |               |             |                |
| 应付赎回款   | -              | -              | -             | 1,911.59    | 1,911.59       |
| 应付管理人报酬 | -              | -              | -             | 103,744.14  | 103,744.14     |
| 应付托管费   | -              | -              | -             | 34,581.39   | 34,581.39      |
| 应付销售服务费 | -              | -              | -             | 292.69      | 292.69         |
| 其他负债    | -              | -              | -             | 63,298.90   | 63,298.90      |
| 负债总计    | -              | -              | -             | 203,828.71  | 203,828.71     |
| 利率敏感度缺口 | 240,774,233.96 | 264,673,493.15 | 72,392,958.91 | -203,758.71 | 577,636,927.31 |

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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2026年06月30日              | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|    | 1.市场利率下降25个基点      | 15,222,525.43                   | 2,768,021.75        |
|    | 2.市场利率上升25个基点      | -14,778,071.94                  | -2,726,377.22       |



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<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 1,207,218,919.34   | 401,417,276.17      |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 1,207,218,919.34   | 401,417,276.17      |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期内及上年度可比期间，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2026年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025年12月31日：无)。

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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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2026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            | 1,207,218,919.34 | 96.31        |
|    | 其中：债券             | 1,207,218,919.34 | 96.31        |
|    | 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          | 43,605,199.90    | 3.48         |
|    | 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      | 2,666,200.26     | 0.21         |
| 8  | 其他各项资产            | 28,867.49        | 0.00         |
| 9  | 合计                | 1,253,519,186.99 | 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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票交易。

### 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

本基金本报告期内未进行股票交易。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

## 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      | 85,959,796.04    | 6.86         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,121,259,123.30 | 89.49        |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,121,259,123.30 | 89.49        |
| 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) | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,207,218,919.34 | 96.35        |

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  | 190215 | 19国开15 | 2,600,000 | 283,229,397.26 | 22.60        |
| 2  | 180210 | 18国开10 | 2,400,000 | 262,043,178.08 | 20.91        |
| 3  | 240215 | 24国开15 | 1,500,000 | 159,147,821.92 | 12.70        |
| 4  | 240210 | 24国开10 | 700,000   | 73,514,383.56  | 5.87         |
| 5  | 220210 | 22国开10 | 600,000   | 64,872,904.11  | 5.18         |

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，国家开发银行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 | 1,847.49  |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 27,020.00 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 28,867.49 |

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<br>级别 | 持<br>有<br>人<br>户 | 户均持有的<br>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<br>份额 | 持有份额  | 占总份<br>额比例 |

|           | 数<br>(户) |               |                  | 比例     |            |       |
|-----------|----------|---------------|------------------|--------|------------|-------|
| 富安达富祥利率债A | 100      | 11,872,470.34 | 1,187,040,130.08 | 99.98% | 206,903.54 | 0.02% |
| 富安达富祥利率债C | 192      | 260,527.05    | 49,304,802.29    | 98.57% | 716,391.70 | 1.43% |
| 富安达富祥利率债D | 0        | 0.00          | 0.00             | 0.00%  | 0.00       | 0.00% |
| 合计        | 292      | 4,237,219.96  | 1,236,344,932.37 | 99.93% | 923,295.24 | 0.07% |

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

| 项目               | 份额级别      | 持有份额总数<br>(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 | 富安达富祥利率债A | 1,039.86      | 0.00%    |
|                  | 富安达富祥利率债C | 10.00         | 0.00%    |
|                  | 富安达富祥利率债D | -             | -        |
|                  | 合计        | 1,049.86      | 0.00%    |

注：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）。

8.3 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 | 富安达富祥利率债A | 0~10              |
|                                | 富安达富祥利率债C | 0~10              |
|                                | 富安达富祥利率债D | -                 |
|                                | 合计        | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 富安达富祥利率债A | 0                 |
|                                | 富安达富祥利率债C | 0                 |
|                                | 富安达富祥利率债D | 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至10万份（含）。
  - 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

|                            | 富安达富祥利率债A      | 富安达富祥利率债C      | 富安达富祥利率债D |
|----------------------------|----------------|----------------|-----------|
| 基金合同生效日(2023年07月27日)基金份额总额 | 965,229,466.26 | 36,083,051.27  | -         |
| 本报告期期初基金份额总额               | 523,412,940.27 | 50,200,932.94  | -         |
| 本报告期基金总申购份额                | 951,413,623.31 | 159,651,726.82 | -         |
| 减：本报告期基金                   | 287,579,529.96 | 159,831,465.77 | -         |

|                  |                  |               |   |
|------------------|------------------|---------------|---|
| 总赎回份额            |                  |               |   |
| 本报告期基金拆分<br>变动份额 | -                | -             | - |
| 本报告期期末基金<br>份额总额 | 1,187,247,033.62 | 50,021,193.99 | - |

§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。

2026年6月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

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。  
报告期内未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

| 管理人受调查或处罚等情况  | 内容          |
|---------------|-------------|
| 受到调查或处罚等措施的主体 | 富安达基金管理有限公司 |
| 受到调查或处罚等措施的时间 | 2026年02月09日 |
| 采取调查或处罚等措施的机构 | 中国证监会上海监管局  |
| 受到调查或处罚等措施类型  | 行政监管措施      |



|                       |                                                       |
|-----------------------|-------------------------------------------------------|
| 受到的具体措施类型             | 责令改正                                                  |
| 受到调查或处罚等措施的原因         | 投资运作、合规内控                                             |
| 受到处罚的依据               | 《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》                 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 公司高度重视，已通过完善制度流程、加强合规宣导、强化事后检查等措施完成整改工作，并已通过监管机构检查验收。 |
| 其他                    | 无                                                     |

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 |    |
| 南京证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

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 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，无新增的交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过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 |
| 南京证券 | 9,000,930.00 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                        | 法定披露方式 | 法定披露日期     |
|----|---------------------------------------------|--------|------------|
| 1  | 富安达基金管理有限公司关于通过直销柜台办理公募基金认、申购、转换转入业务费率优惠的公告 | 规定媒介   | 2026-01-07 |
| 2  | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告                  | 规定媒介   | 2026-01-21 |
| 3  | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金2025年第4季度报告                | 规定媒介   | 2026-01-21 |
| 4  | 富安达基金管理有限公司关于通过直销柜台办理公募基金认、申购、转换转入业务        | 规定媒介   | 2026-01-23 |

|    |                                            |      |            |
|----|--------------------------------------------|------|------------|
|    | 费率优惠的公告                                    |      |            |
| 5  | 富安达基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告     | 规定媒介 | 2026-02-03 |
| 6  | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金春节前暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告   | 规定媒介 | 2026-02-11 |
| 7  | 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 | 2026-02-27 |
| 8  | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告                 | 规定媒介 | 2026-03-28 |
| 9  | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金2025年年度报告                 | 规定媒介 | 2026-03-28 |
| 10 | 富安达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度） | 规定媒介 | 2026-03-31 |
| 11 | 富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告                 | 规定媒介 | 2026-04-21 |
| 12 | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金2026年第1季度报告               | 规定媒介 | 2026-04-21 |
| 13 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                   | 规定媒介 | 2026-04-27 |
| 14 | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金劳动节前暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告  | 规定媒介 | 2026-04-28 |
| 15 | 2025年度富安达基金管理有                             | 规定媒介 | 2026-04-30 |

|    |                                                       |      |            |
|----|-------------------------------------------------------|------|------------|
|    | 限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露                        |      |            |
| 16 | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金分红公告                                 | 规定媒介 | 2026-05-07 |
| 17 | 富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告                              | 规定媒介 | 2026-05-20 |
| 18 | 富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加万家财富基金销售（天津）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 | 2026-06-25 |
| 19 | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二六年第一号）                  | 规定媒介 | 2026-06-26 |
| 20 | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金招募说明书更新提示性公告                         | 规定媒介 | 2026-06-26 |
| 21 | 富安达富祥利率债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新                           | 规定媒介 | 2026-06-26 |

§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              | 20260101-20260630      | 285,007,600.23 | 0.00           | 0.00 | 285,007,600.23 | 23.04% |
|        | 2              | 20260116-20260630      | 0.00           | 604,341,615.97 | 0.00 | 604,341,615.97 | 48.84% |
|        | 3              | 20260512-20260630      | 0.00           | 297,690,913.88 | 0.00 | 297,690,913.88 | 24.06% |
| 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、中国证监会准予富安达富祥利率债债券型证券投资基金注册的文件：  
《富安达富祥利率债债券型证券投资基金招募说明书》；  
《富安达富祥利率债债券型证券投资基金基金合同》；  
《富安达富祥利率债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](http://www.fadfunds.com)）查阅。

富安达基金管理有限公司  
二〇二六年八月二十九日