

富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:富达基金管理(中国)有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本基金基金合同生效日为 2026 年 01 月 15 日，本报告期自 2026 年 01 月 15 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	37
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	38
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	38
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	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38

§ 8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	41
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	42
10.8 其他重大事件	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	43
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	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金	
基金简称	富达中债高等级科创及绿债	
基金主代码	025707	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 01 月 15 日	
基金管理人	富达基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,610,233,302.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富达中债高等级科创及绿债 A	富达中债高等级科创及绿债 C
下属分级基金的交易代码	025707	025708
报告期末下属分级基金的份 额总额	2,609,785,534.88 份	447,767.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以标的指数的成份券及备选成份券为主要投资对象来实现对标的指数的有效跟踪，力争实现与标的指数表现相似的长期回报。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。 1、优化抽样复制策略 本基金将采用抽样复制和动态最优化的方法，主要以标的指数的成份券构成为基础，或选择非成份券作为替代，综合考虑指数成份券流动性、基金日常申购赎回以及成份券交易特性及交易惯例等情况进行优化，以保证对标

	的指数的有效跟踪。 2、替代性策略 当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券和备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券和备选成份券外寻找其他证券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。 3、其他债券投资策略 本基金还可以在控制风险的前提下，通过深入研究宏观经济发展状况，预测价格和利率变化趋势，在债券组合久期调整、信用评级调整及期限结构配置基础上，采取积极的投资策略，确定类属资产的最优配置比例，并灵活运用多种投资策略，在合理管理并控制组合风险的前提下，获得债券市场的整体回报率及超额收益。
业绩比较基准	中债-高等级科技创新及绿色债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
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，低于混合型基金和股票型基金。 本基金为指数型基金，主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

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		富达基金管理（中国）有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈星德	张立学
	联系电话	021-60119696	010-68858126
	电子邮箱	FIL-FMC-GC-Compliance@fidelity.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-920-9898	95580
传真		021-60119601	010-86353609
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 7 层 701 室	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 7 层 701 室	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		200120	100808
法定代表人		EDMOND TANUWIDJAJA	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
----------------	------

登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.fidelity.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	招商证券股份有限公司	广东省深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦

§ 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（2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）-2026 年 06 月 30 日）	
	富达中债高等级科创及绿债 A	富达中债高等级科创及绿债 C
本期已实现收益	15,845,809.41	4,364.19
本期利润	18,692,566.72	4,588.33
加权平均基金份额本期利润	0.0071	0.0029
本期加权平均净值利润率	0.70%	0.29%
本期基金份额净值增长率	0.73%	0.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	16,016,599.48	2,452.25
期末可供分配基金份额利润	0.0061	0.0055
期末基金资产净值	2,628,738,681.08	450,723.15
期末基金份额净值	1.0073	1.0066
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	0.73%	0.66%

注：（1）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。

（2）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，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

（4）本基金基金合同于 2026 年 01 月 15 日生效，截止 2026 年 06 月 30 日，本基金成立未满 6 个月。

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

富达中债高等级科创及绿债 A 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.46%	0.01%	0.35%	0.02%	0.11%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	0.73%	0.01%	0.83%	0.02%	-0.10%	-0.01%

富达中债高等级科创及绿债 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.43%	0.01%	0.35%	0.02%	0.08%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	0.66%	0.01%	0.83%	0.02%	-0.17%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准为：中债-高等级科技创新及绿色债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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

富达中债高等级科创及绿债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
(2026年01月15日-2026年06月30日)



富达中债高等级科创及绿债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
(2026年01月15日-2026年06月30日)



注：（1）本基金基金合同生效日为 2026 年 01 月 15 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

（2）本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2026 年 06 月 30 日，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

富达基金管理（中国）有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 05 月 27 日成立，并于 2022 年 12 月 9 日正式获批开展公开募集证券投资基金管理、基金销售、私募资产管理业务。本基金管理人旗下产品覆盖主动权益、固定收益、FOF 投资、海外投资、量化投资等类别，为客户提供标准化和定制化的资产管理服务。公司由富达亚洲控股私人有限公司 100%控股，富达亚洲控股私人有限公司是富达国际全资控股的公司。

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		
成皓	基金经理/ 固定收益部副总监	2026-01-15	-	16 年	成皓先生，上海交通大学工学硕士学位，特许金融分析师资格。

					2021 年 11 月加入富达基金管理（中国）有限公司，现任固定收益部副总监、基金经理。2023 年 11 月 22 日起任富达裕达纯债债券型证券投资基金基金经理、2024 年 1 月 30 日起任富达 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理、2024 年 9 月 19 日至 2025 年 12 月 16 日任富达中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、2024 年 12 月 17 日起任富达中债 0-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、2026 年 1 月 15 日起任富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金基金经理。曾任富达利泰投资管理（上海）有限公司投资经理、固定收益研究员，惠誉（北京）信用评级有限公司上海分公司董事，财富里昂证券有限责任公司（现更名为上海华信证券有限责任公司）分析师，法国巴黎资本上海办事处分析师，艾意凯咨询有限公司助理咨询顾问等职务。
黄艾克	基金经理助理/ 固定收益研究员	2026-01-15	-	3 年	黄艾克先生，美国太平洋大学工商管理学硕士学位。2023 年 2 月加入富达基金管理（中国）有限公司，现任固定收益部研究员、基金经理助理。曾任惠誉（北京）信用评级有限公司国际公共融资团队董事，易唯思商务咨询(上海)有限公司高级分析师等职务。

注：（1）此处的任职日期和离任日期分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

（2）证券从业的含义遵从中国证监会《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》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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

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》，公司建立了《富达基金管理(中国)有限公司公平交易制度》等公平交易相关制度体系，并通过研究分析、投资决策、授权管理、交易执行、业绩评估等投资管理环节，进行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理，确保公平交易原则的实现。公司通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保所有组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对异常交易行为的监控、分析和评估，完成对公平交易过程和结果的有效监督。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，未发现不公平交易和利益输送行为。

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

2026 年上半年，信用债市场在总体流动性平稳宽裕、信用风险总体可控以及配置需求旺盛的背景下表现稳健，信用利差继续压缩并维持在历史较低水平。

一季度，利率市场整体呈现明显陡峭化趋势，国内经济数据韧性与外部地缘冲突共同影响利率曲线形态；但在银行体系流动性充裕、银行理财与纯债资金持续增配的背景下，中短端债券，特别是高等级信用债，仍获得较强配置支持。信用环境方面，信用风险总体平稳，在需求旺盛、供给平稳的背景下，信用债收益表现稳健，信用利差维持历史低位。

二季度，国内经济继续呈现“出口与高技术行业偏强、内需与地产偏弱”的分化格局，债券市场收益率震荡下行。资金面维持平稳充裕，4-5 月资金利率明显低于政策利率，进一步强化了机构配置需求；但 6 月在央行纠偏及理财赎回扰动下，信用债市场短暂调整，随后重回修复。整体看，上半年信用债收益率全线下行，信用利差普遍收窄多数信用债收益率已降至 1.8%以内。信用利差在供需错配背景下继续缩窄并维持低位。同时，科创债与绿色债券市场延续平稳扩容，产业政策与资金配置共振下，高等级科创债和绿债持续受到市场青睐，为本基金的投资运作提供了较好的市场基础。

报告期内，本基金围绕标的指数成份券开展投资，以高等级科创债与绿债为主要配置方向，并结合市场环境变化动态调整久期与仓位。

基金成立前六个月内处于稳步建仓阶段，信用债持仓品种主要为标的指数成份券，着重把握高

等级信用资产在流动性宽松和配置需求旺盛环境下的稳健收益机会，并根据市场波动对久期与仓位进行动态管理。从信用风险控制角度看，基金坚持高等级资产为主的配置思路，避免在信用利差已处低位的环境中过度下沉，以防范流动性扰动和个券信用事件对净值造成不必要的波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富达中债高等级科创及绿债 A 基金份额净值为 1.0073 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%；截至报告期末富达中债高等级科创及绿债 C 基金份额净值为 1.0066 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度及更长期，信用债市场仍有望受益于稳定的信用环境、持续较强的配置需求以及总体偏支持的流动性环境，但在利差已压缩至历史较低水平的情况下，获取超额收益的难度将有所上升。

基本面方面，出口和高技术行业仍有望维持较强表现，但内需修复仍需观察政策传导效果；货币政策预计仍将维持适度宽松基调，但资金面将更加注重“合理充裕”而非单边宽松。在此背景下，信用市场整体表现有望继续维持稳健，但若后续出现资金面边际收敛、赎回压力上升或局部信用事件扰动，信用利差可能阶段性走阔。本基金将继续坚持以高等级科创债和绿债为主的配置策略，密切关注行业政策、融资供给、信用利差和市场流动性变化，在控制信用风险和流动性风险的前提下，力争提升组合的风险调整后收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法律法规和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构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，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

本基金由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所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

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金

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 2026 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	14,955,817.13
结算备付金		—
存出保证金		—

交易性金融资产	6.4.7.2	2,614,868,648.20
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		2,614,868,648.20
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	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		2,030.82
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		2,629,826,496.15
负债和净资产	附注号	本期末 2026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		—
应付赎回款		19,667.63
应付管理人报酬		315,372.16
应付托管费		105,124.05
应付销售服务费		36.44
应付投资顾问费		—
应交税费		84,593.29
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.6	112,298.35
负债合计		637,091.92
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	2,610,233,302.23
未分配利润	6.4.7.8	18,956,102.00
净资产合计		2,629,189,404.23
负债和净资产总计		2,629,826,496.15

注：(1) 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0073 元，基金份额总额为 2,610,233,302.23 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.0073 元，份额总额为 2,609,785,534.88 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.0066 元，份额总额为 447,767.35 份。

(2) 本基金基金合同于 2026 年 01 月 15 日生效，故无上年度可比区间数据。本期财务报表的实际

编制期间为 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 15 日（基金合同 生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		21,220,015.63
1. 利息收入		6,299,426.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,819,262.83
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		3,480,163.46
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,073,161.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	12,073,161.69
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	2,846,981.45
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	446.20
减：二、营业总支出		2,522,860.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,795,400.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	598,466.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	572.05
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		7.70
其中：卖出回购金融资产支出		7.70
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		41,190.56
8. 其他费用	6.4.7.19	87,223.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,697,155.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,697,155.05

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		18,697,155.05

注：本基金合同于 2026 年 1 月 15 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

6.3 净资产变动表

会计主体：富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	4,000,428,561.81	-	4,000,428,561.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 1,390,195,259.58	18,956,102.00	- 1,371,239,157.58
（一）、综合收益总额	-	18,697,155.05	18,697,155.05
（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）	- 1,390,195,259.58	258,946.95	- 1,389,936,312.63
其中：1. 基金申购款	180,568,227.58	758,428.82	181,326,656.40
2. 基金赎回款	- 1,570,763,487.16	-499,481.87	- 1,571,262,969.03
（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	2,610,233,302.23	18,956,102.00	2,629,189,404.23

注：本基金合同于 2026 年 1 月 15 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

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：

EDMOND TANUWIDJAJA	EDMOND TANUWIDJAJA	郁骥
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

富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金(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[2025]2115《关于准予富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由富达基金管理（中国）有限公司依照《中华

《中华人民共和国证券投资基金法》和《富达中债高等级科技创新及绿色债券指数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，本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,000,424,908.35 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(26)第 00015 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金基金合同》于 2026 年 1 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,000,428,561.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,653.46 份基金份额。本基金的基金管理人为富达基金管理（中国）有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金基金合同》和《富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金招募说明书》，基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者认购或申购时收取认购费或申购费，但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；在投资者认购或申购时不收取认购费或申购费，而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。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值，计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括非属成份券及备选成份券的债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分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、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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。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%；投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金每个交易日日终保持不低于基金资产净值 5%的现金或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、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准：中债-高等级科技创新及绿色债券指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 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

本基金的会计年度为公历年度，即每年 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 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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，且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，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产

支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价

值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应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，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转入、转出、类别调整等引起的基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产利息收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代

缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

(5) 其他收入

本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率逐日计提。

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.10%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产款的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同；

- (3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；
- (4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致并履行一定程序后可调整以上基金收益的分配原则。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

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。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566号）所规定的固定收益品种，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种使用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《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[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[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《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》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027 年 12 月 31 日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税；
- (2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 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；
- (3) 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；
- (4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2026 年 06 月 30 日
活期存款	14,954,959.51
等于：本金	14,930,714.75
加：应计利息	24,244.76
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	857.62

等于：本金	855.30
加：应计利息	2.32
减：坏账准备	-
合计	14,955,817.13

注：其他存款为本基金存放于证券经纪商的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 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 券	交易所市场	631,865,842.61	4,055,631.79	637,294,631.79	1,373,157.39
	银行间市场	1,964,770,175.94	11,330,016.41	1,977,574,016.41	1,473,824.06
	合计	2,596,636,018.55	15,385,648.20	2,614,868,648.20	2,846,981.45
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,596,636,018.55	15,385,648.20	2,614,868,648.20	2,846,981.45

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金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 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	25,875.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	25,875.00
应付利息	-
预提费用-审计费	21,629.39
预提费用-信息披露费	57,093.96
预提费用-账户维护费	7,700.00
合计	112,298.35

6.4.7.7 实收基金

富达中债高等级科创及绿债 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,980,008,381.00	3,980,008,381.00
本期申购	179,862,457.75	179,862,457.75
本期赎回（以“-”号填列）	-1,550,085,303.87	-1,550,085,303.87
本期末	2,609,785,534.88	2,609,785,534.88

富达中债高等级科创及绿债 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	20,420,180.81	20,420,180.81
本期申购	705,769.83	705,769.83
本期赎回（以“-”号填列）	-20,678,183.29	-20,678,183.29
本期末	447,767.35	447,767.35

注：（1）本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

（2）本基金基金合同于 2026 年 01 月 15 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 4,000,424,908.35 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 3,653.46 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 4,000,428,561.81 元，折合 4,000,428,561.81 份基金份额，其中 A 类基金份额 3,980,008,381.00 份，C 类基金份额 20,420,180.81 份。

6.4.7.8 未分配利润

富达中债高等级科创及绿债 A

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
本期期初	-	-	-
本期利润	15,845,809.41	2,846,757.31	18,692,566.72

本期基金份额交易产生的变动数	170,790.07	89,789.41	260,579.48
其中：基金申购款	685,578.42	70,640.91	756,219.33
基金赎回款	-514,788.35	19,148.50	-495,639.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,016,599.48	2,936,546.72	18,953,146.20

富达中债高等级科创及绿债 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
本期期初	-	-	-
本期利润	4,364.19	224.14	4,588.33
本期基金份额交易产生的变动数	-1,911.94	279.41	-1,632.53
其中：基金申购款	1,911.16	298.33	2,209.49
基金赎回款	-3,823.10	-18.92	-3,842.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,452.25	503.55	2,955.80

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	2,767,815.39
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	18,447.17
结算备付金利息收入	-
其他	33,000.27
合计	2,819,262.83

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

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 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,554,967.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-481,806.18

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	12,073,161.69

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 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日） 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	4,684,682,471.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,651,565,067.37
减：应计利息总额	33,080,376.89
减：交易费用	518,833.75
买卖债券差价收入	-481,806.18

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,846,981.45
——股票投资	-
——债券投资	2,846,981.45
——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	2, 846, 981. 45

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	446. 20
合计	446. 20

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	21, 629. 39
信息披露费	57, 093. 96
证券出借违约金	—
汇划手续费	400. 00
账户维护费_中债登	4, 500. 00
开户费	400. 00
账户维护费_上清所	3, 200. 00
合计	87, 223. 35

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
富达基金管理（中国）有限公司 （“富达基金”）	基金管理人、基金销售机构

中国邮政储蓄银行股份有限公司 (“邮储银行”)	基金托管人、基金代销机构
----------------------------	--------------

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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无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 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,795,400.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	223,566.74
应支付基金管理人的净管理费	1,571,833.45

注：1、根据基金合同的规定，支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.15%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

2、其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×管理费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	598,466.73

注：1、根据基金合同的规定，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.05\%$ 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

2、其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 $\times$ 托管费率/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 2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富达中债高等级科创及 绿债 A	富达中债高等级科创及 绿债 C	合计
邮储银行	-	-	-
富达基金	-	438.41	438.41
合计	-	438.41	438.41

注：1、根据基金合同的规定，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 $\times 0.10\%$ 年费率逐日累计至每月月底，按月支付。

2、其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额的资产净值 $\times 0.10\%$ /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

本基金本报告期内无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。

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

本基金本报告期内无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。

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

本基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

富达中债高等级科创及绿债 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额

		的比例
邮储银行	1,029,999,000.00	39.47%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书和相关公告公布的费率执行。

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	
	2026 年 01 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
邮储银行	14,954,959.51	2,767,815.39

注：本基金的银行存款由基金托管人邮储银行保管，按银行同业利率或协定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无参与转融通出借业务的证券。

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

本基金在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金投资目标是以标的指数的成份券及备选成份券为主要投资对象来实现对标的指数的有效跟踪，力争实现与标的指数表现相似的长期回报。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，风险管理架构根据三道防线模型设计，以确保清晰的责任和风险管理活动贯穿整个组织。在董事会层下设风险控制委员会，负责公司的风险策略和监督公司内部控制和风险管理制度的有效性。在公司经营管理层下设风险与合规委员会，负责对公司日常经营管理和基金投资业务进行风险与合规监督，并向董事会风险控制委员会进行汇报。在业务操作层面，业务部门作为一道防线负责对各自业务领域风险进行管控。公司的风险政策，标准和框架由风控部、合规部、法务部等二道防线负责制定，组织、协调并与各业务部门共同完成对各类型风险的管理，并定期向公司风险与合规委员会报告公司风险状况。内审部作为第三道防线对内部控制、风险管理框架及治理流程的设计充分性及运行有效性提供独立、客观的鉴证。风控部、合规部、法务部均向督察长报告工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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邮储银行，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。

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 2026 年 06 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-

未评级	221,593,014.79
合计	221,593,014.79

注：（1）债券评级取自第三方评级机构。（2）债券投资以全价列示。（3）统计范围未包含国债、央行票据。（4）上述未评级债券包含无债项信用评级的债券（例如无信用评级的政策性金融债等）。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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 2026 年 06 月 30 日
AAA	517,823,972.61
AAA 以下	—
未评级	1,795,442,830.67
合计	2,313,266,803.28

注：（1）债券评级取自第三方评级机构。（2）债券投资以全价列示。（3）统计范围未包含国债、央行票据。（4）上述未评级债券包含无债项信用评级的债券（例如无信用评级的政策性金融债等）。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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，通过独立的风控部对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散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。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金及交易性金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 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	14,955,817.13	-	-	-	14,955,817.13

交易性金融资产	708,370,338.07	1,906,498,310.13	-	-	2,614,868,648.20
应收申购款	-	-	-	2,030.82	2,030.82
资产总计	723,326,155.20	1,906,498,310.13	-	2,030.82	2,629,826,496.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,667.63	19,667.63
应付管理人报酬	-	-	-	315,372.16	315,372.16
应付托管费	-	-	-	105,124.05	105,124.05
应付销售服务费	-	-	-	36.44	36.44
应交税费	-	-	-	84,593.29	84,593.29
其他负债	-	-	-	112,298.35	112,298.35
负债总计	-	-	-	637,091.92	637,091.92
利率敏感度缺口	723,326,155.20	1,906,498,310.13	-	- 635,061.10	2,629,189,404.23

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2026 年 06 月 30 日
	市场利率上升 25 个基点	-13,052,269.16
	市场利率下降 25 个基点	13,175,676.73

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币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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	—	—
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,614,868,648.20	99.46
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	2,614,868,648.20	99.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 2026 年 06 月 30 日
第一层次	—
第二层次	2,614,868,648.20
第三层次	—
合计	2,614,868,648.20

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	2,614,868,648.20	99.43
	其中：债券	2,614,868,648.20	99.43
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,955,817.13	0.57
8	其他各项资产	2,030.82	0.00
9	合计	2,629,826,496.15	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境内股票投资组合。

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投资股票投资组合。

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

本基金本报告期内未进行买入股票投资交易。

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

本基金本报告期内未进行卖出股票投资交易。

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买入、卖出股票投资交易。

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	80,008,830.13	3.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,032,858,213.69	39.28
	其中：政策性金融债	821,077,827.39	31.23
4	企业债券	648,199,190.15	24.65
5	企业短期融资券	221,593,014.79	8.43
6	中期票据	632,209,399.44	24.05
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,614,868,648.20	99.46

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	220208	22 国开 08	2,300,000	233,267,260.27	8.87
2	250208	25 国开 08	2,000,000	200,491,890.41	7.63
3	230208	23 国开 08	1,500,000	153,548,178.08	5.84
4	09250412	25 农发清发 12	1,400,000	140,774,410.96	5.35
5	332580001	25 工行科创债 01BC	1,000,000	100,537,205.48	3.82

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期内基金投资的前十名证券除 25 交通银行科创债 01(2528011. IB), 22 国开 08(220208. IB), 25 工行科创债 01BC(332580001. IB), 25 国开 08(250208. IB), 23 国开 08(230208. IB), 23 国开 03(230203. IB), 25 农发清发 12(09250412. IB) 外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查, 或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

国家金融监督管理总局 2026 年 06 月 05 日发布对交通银行股份有限公司的处罚, 中国人民银行 2025 年 12 月 19 日发布对交通银行股份有限公司的处罚(银罚决字(2025)96-109 号), 国家外汇管理局北京市分局 2025 年 07 月 25 日发布对国家开发银行的处罚(京汇罚(2025)30 号), 国家金融监督管理总局 2025 年 08 月 01 日发布对中国农业发展银行的处罚, 中国人民银行 2025 年 12 月 19 日发布对中国工商银行股份有限公司的处罚(银罚决字(2025)110 号-127 号), 中国人民银行北京市分行(中国人民银行营业管理部、国家外汇管理局北京市分局)2025 年 12 月 18 日发布对中国工商银行股份有限公司的处罚(京汇罚(2025)49 号), 国家金融监督管理总局 2026 年 06 月 05 日发布对中国工商银行股份有限公司的处罚, 中国人民银行 2025 年 09 月 30 日发布对国家开发银行的处罚(银罚决字(2025)66 号)。

前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作, 上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期末未持有股票, 故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同约定之备选股票

库的情况。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,030.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,030.82

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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
富达中 债高等 级科创 及绿债 A	262	9,961,013.49	2,609,457,624.63	99.99%	327,910.25	0.01%
富达中 债高等 级科创	87	5,146.75	0.00	0.00%	447,767.35	100.00%

及绿债 C						
合计	349	7,479,178.52	2,609,457,624.63	99.97%	775,677.60	0.03%

注：本基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属不同类别的基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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 (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	富达中债高等级科创及绿债 A	9.97	0.0000%
	富达中债高等级科创及绿债 C	0.00	0.0000%
	合计	9.97	0.0000%

注：从业人员持有基金占基金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	富达中债高等级科创及绿债 A	0
	富达中债高等级科创及绿债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富达中债高等级科创及绿债 A	0
	富达中债高等级科创及绿债 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富达中债高等级科创及绿债 A	富达中债高等级科创及绿债 C
基金合同生效日（2026 年 01 月 15 日）基金份额总额	3,980,008,381.00	20,420,180.81
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	179,862,457.75	705,769.83
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,550,085,303.87	20,678,183.29

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	2,609,785,534.88	447,767.35

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

无。

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

报告期内基金管理人的重大人事变动如下：

董事长李少杰于 2026 年 4 月 17 日离任，DAMIEN MARTIN MOONEY 于 2026 年 4 月 17 日起任董事长。

总经理、法定代表人 CHEN SUN 于 2026 年 5 月 26 日离任总经理、法定代表人；财务负责人 EDMOND TANUWIDJAJA 于 2026 年 5 月 26 日起代任总经理、法定代表人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金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

本基金自合同生效日起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内，管理人无受调查或处罚等情况。

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无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

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，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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	
国信证券	2	-	-	487,033.75	100.00%	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、本基金根据法律法规要求，管理证券交易费用。本基金采用券商结算模式，故不适用单一券商分仓上限的要求。此外，本基金合同生效日为 2026 年 01 月 15 日，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

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
国信证	2,435,168,696.67	100.00%	58,942,397,000.00	100.00%	-	-	-	-

券							
---	--	--	--	--	--	--	--

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	富达基金管理(中国)有限公司关于富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-14
2	富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2026-01-16
3	富达基金管理(中国)有限公司关于富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-21
4	富达基金管理(中国)有限公司关于富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金提高 C 类基金份额净值精度的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-24
5	富达基金管理(中国)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)	中国证监会规定媒介	2026-03-31
6	富达基金管理(中国)有限公司关于在直销中心开展认(申)购、转换费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-15
7	富达基金管理(中国)有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-18
8	富达中债高等级科技创新及绿色债券指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
9	富达基金管理(中国)有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-28

§ 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	2026 年 01 月 15 日-2026 年 06 月 30 日	1,029,999,000.00	-	-	1,029,999,000.00	39.46%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，							

存在可能因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、巨额赎回风险、净值波动风险以及因巨额赎回造成基金规模持续低于正常水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同等特有风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金自 2026 年 1 月 21 日起每个开放日办理日常申购、赎回及定期定额投资业务。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会准予注册的文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

以上备查文件存于基金管理人及基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<https://www.fidelity.com.cn>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

富达基金管理（中国）有限公司
二〇二六年八月三十一日