

---

# 富达传承 6 个月持有期股票型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:富达基金管理(中国)有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8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。

本报告期自2024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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53

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.....	54
§9 开放式基金份额变动 .....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富达传承6个月持有期股票型证券投资基金	
基金简称	富达传承6个月股票	
基金主代码	017931	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年04月25日	
基金管理人	富达基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	711,395,089.74份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富达传承6个月股票A	富达传承6个月股票C
下属分级基金的交易代码	017931	017932
报告期末下属分级基金的份额总额	340,137,762.25份	371,257,327.49份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。</p> <p>2、股票投资策略：</p> <p>（1）行业配置策略——本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势等深入研究，在把握宏观经济运行趋势和股票市场行业轮动的基础上，综合考虑行业景气度等因素，确定并动态调整行业配置。</p> <p>（2）个股选择策略——本基金依托于基金管理人的投资研究平台，采用“自下而上”的选股策略精选高质量并匹配合理估值的个股，通过定性分析与定量分析相结合的分析方法选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资。</p>

	<p>(3) 港股通标的股票投资策略——重点关注1) A股稀缺性行业个股，2) 具有持续领先优势或核心竞争力的公司，和3) 与A股同类公司相比具有估值优势的公司。</p> <p>3、债券投资策略：根据基金流动性管理及策略性投资的需要投资于债券资产，主要策略包括利率策略、信用策略等。</p> <p>4、可转换债券、可交换债券投资策略：综合考虑可转换债券与可交换债券的股性和债性进行投资。</p> <p>5、存托凭证投资策略：结合对宏观经济状况、行业景气度等因素的分析，选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p> <p>6、金融衍生产品投资策略：包括股指期货与国债期货投资策略，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，谨慎适度参与股指期货和国债期货的投资。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债-0-1年国债财富（总值）指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈星德	许俊
	联系电话	021-60119696	010-66596688
	电子邮箱	FIL-FMC-GC-Compliance@fidelity.com.cn	fxjd_hq@bankofchina.com
客户服务电话		400-920-9898	95566
传真		021-60119601	010-66594942

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	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	XIAOYI HELEN HUANG	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fidelity.com.cn
基金中期报告备置地点	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	广东省深圳市南山区高新南九道9号金地威新软件科技园6号楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	富达传承6个月股票A	富达传承6个月股票C
本期已实现收益	-22,755,110.88	-26,787,858.39
本期利润	20,204,563.92	22,395,733.02

加权平均基金份额本期利润	0.0550	0.0546
本期加权平均净值利润率	6.08%	6.08%
本期基金份额净值增长率	6.91%	6.60%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-39,892,853.79	-45,832,159.83
期末可供分配基金份额利润	-0.1173	-0.1235
期末基金资产净值	318,808,662.28	345,515,993.76
期末基金份额净值	0.9373	0.9307
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-6.27%	-6.93%

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等未实现收益。

（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。

## 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

富达传承6个月股票A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.69%	0.60%	-2.80%	0.42%	1.11%	0.18%
过去三个月	4.35%	0.72%	-0.87%	0.67%	5.22%	0.05%
过去六个月	6.91%	0.82%	1.54%	0.80%	5.37%	0.02%
过去一年	-4.64%	0.80%	-8.24%	0.78%	3.60%	0.02%



自基金合同生效起至今	-6.27%	0.75%	-10.87%	0.78%	4.60%	-0.03%
------------	--------	-------	---------	-------	-------	--------

## 富达传承6个月股票C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.73%	0.60%	-2.80%	0.42%	1.07%	0.18%
过去三个月	4.20%	0.72%	-0.87%	0.67%	5.07%	0.05%
过去六个月	6.60%	0.82%	1.54%	0.80%	5.06%	0.02%
过去一年	-5.20%	0.80%	-8.24%	0.78%	3.04%	0.02%
自基金合同生效起至今	-6.93%	0.75%	-10.87%	0.78%	3.94%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债-0-1年国债财富（总值）指数收益率×10%。

### 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

富达传承6个月股票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  
(2023年04月25日-2024年06月30日)



富达传承6个月股票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04月25日-2024年06月30日)



注：按基金合同的规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §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5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。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子公司。截至报告期末，公司旗下发行并管理了4只公开募集证券投资基金：富达传承6个月持有期股票型证券投资基金，富达裕达纯债债券型证券投资基金，富达90天持有期债券型证券投资基金，富达悦享红利优选混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周文群	基金经	2023-	-	7年	周文群女士，香港城市大学金融硕士

	理、股票部副总监	04-25			学位，特许金融分析师资格。2021年1月加入富达基金管理（中国）有限公司，现任股票部副总监、基金经理。2023年4月起任富达传承6个月持有期股票型证券投资基金基金经理，2024年4月起任富达悦享红利优选混合型证券投资基金基金经理。曾任中银保诚资产管理有限公司分析师，景顺香港资产管理有限公司分析师、基金经理，FIL Investment Advisors (Incorporated in Bermuda) 分析师、股票研究部主管、基金经理，及富达利泰投资管理（上海）有限公司投资经理。
李瑞鹏	基金经理助理、股票研究员	2023-08-22	-	4年	李瑞鹏先生，北京大学金融硕士和理学学士学位。2022年11月加入富达基金管理（中国）有限公司，现任股票研究员和基金经理助理。曾任东方红资管股票研究员。

注：（1）此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，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，通过制度确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，严格防范不同投资组合之间进行利益输送。从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，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、分析和评估确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等投资管理活动和环节得到公平对待。

各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，公司公平对待各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金不存在异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

#### 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

2024年上半年市场整体呈现区间震荡，但是结构分化较大。市场层面，一季度主要是从快速回调到反弹的过山车行情，在经历了1月份的调整之后，2月份受益于中央汇金等增量资金入市，市场迅速反弹，并在3月份震荡蓄力。A股沪深300指数和港股恒生指数最大回撤分别达到6.1%和10.9%。进入二季度投资环境依然充满挑战，A股和港股整体均呈现先上后下的走势，从4月到5月初，国内政策端的一些积极变化提升市场情绪和风险偏好，新“国九条”驱动市场聚焦核心资产，高ROE传统白马股表现突出，以互联网为代表的港股公司增加了回购，ROE改善，叠加估值低位，整体性价比提升，在此背景下从区域内其他国家流入的资金推动市场表现；在部分政策落地后，可以看到经济复苏进程中依然存在各种掣肘，从5月中到季末，整体市场处于一个底部震荡态势。行业层面，上半年分化相对较大且轮动速度有所加快，红利相关板块维持强势，银行、煤炭、公用事业行业强势领涨，录得超10%涨幅；成长相关板块继续面临较大压力，计算机、传媒、医药等行业累计跌幅均超20%，AI相关板块依然是其中少数亮点，电子行业6月反弹3.2%。

上半年本基金A份额实现6.91%的正收益，跑赢同期比较基准5.37%。报告期内，本基金维持能源、材料高配，能源板块的增配和选股是超额收益的主要来源，此外医药板块低配，信息技术板块内选股超配消费电子，也对超额有所贡献；主要负责来自对银行和公用事业板块的低配。报告期末较年初整体仓位略有降低，结构上结合内需偏弱的情况，降低了对食品饮料和地产相关标的的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富达传承6个月股票A基金份额净值为0.9373元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.91%，同期业绩比较基准收益率为1.54%；截至报告期末富达传承6个月股票C基金份额净值为0.9307元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.60%，同期业绩比较基准收益率为1.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年上半年宏观整体表现平淡，出口是其中主要的亮点。国内宏观政策仍有待进一步发力，但可以看到地产端已经把供需平衡放到更重要的位置，5月的一系列政策整体显示出监管层想要推动房地产市场逐步回归正轨的明确态度。近期政治局会议明确指出了“新旧动能转换存在阵痛”的现实，并强调“宏观政策要持续用力、更加给力”以及“要加强逆周期调节”，反映出政策制定者稳增长的意愿和迫切性有所提升。目前市场的核心关注点仍是地产相关政策以及特别国债用于设备更新等具体实施情况。海外也面临较大扰动，虽然目前外需仍在高位运行，但大选年贸易政策变数较大，需要进一步保持跟踪。

经济复苏过程不会一帆风顺，后续策略整体维持平稳，市场结构分化预期会持续，需要继续关注结构性机会。政策积极倡导提高股东回报，鼓励上市公司增加派息、加大回购，有利于资本市场长期发展，低利率环境下股息率的相对吸引力明显，持续看好相对稳健的高股息板块。内需相关板块基调依然是防守反击，宏观磨底阶段进一步重视公司自身基本面优势带来的回报。另外，在对分红回报率愈加重视的当下，需要进一步重视公司治理对于分红回报率的影响，优选有正向变化的投资机会。外需整体相对活跃，即使在贸易冲突概率增加的背景下，出海依然会是中国企业的长期发展方向。我们需要对全球布局的企业进行更为深入的跟踪，海外投资的不确定性相对更大，对公司能力的要求也相应会更高。另外，继续关注全球定价的上游板块，并紧密跟踪AI应用持续发展对科技行业的整体拉动。

#### 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《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，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。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。

#### 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富达传承6个月持有期股票型证券投资基金（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。

#### 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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、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：富达传承6个月持有期股票型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	4,716,243.87	6,882,803.07
结算备付金		9,754.18	1,001.68
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	646,871,113.18	762,697,282.54
其中：股票投资		606,231,572.20	711,725,830.48
基金投资		-	-
债券投资		40,639,540.98	50,971,452.06
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	12,060,120.60	16,517,297.87
应收清算款		3,705,880.55	-
应收股利		2,544,617.72	-
应收申购款		25,828.45	13,937.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		669,933,558.55	786,112,322.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023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		1,947,705.39	4,447,532.04
应付赎回款		2,615,029.46	2,088,996.22
应付管理人报酬		672,379.93	798,878.77
应付托管费		112,063.34	133,146.47
应付销售服务费		175,011.12	210,802.60

应付投资顾问费		-	-
应交税费		164.03	1,338.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	86,549.24	136,500.00
负债合计		5,608,902.51	7,817,194.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	711,395,089.74	889,670,750.02
未分配利润	6.4.7.12	-47,070,433.70	-111,375,621.62
净资产合计		664,324,656.04	778,295,128.40
负债和净资产总计		669,933,558.55	786,112,322.95

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值0.9338元，基金份额总额为711,395,089.74份，其中下属A类基金份额净值为人民币0.9373元，份额总额为340,137,762.25份；下属C类基金份额净值为人民币0.9307元，份额总额为371,257,327.49份。

## 6.2 利润表

会计主体：富达传承6个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年04月25日（基金 合同生效日）至2023年 06月30日
一、营业总收入		48,665,230.30	-15,048,652.17
1.利息收入		64,886.89	1,374,554.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,529.73	114,158.07
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		49,357.16	1,260,396.68



其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-43,542,922.80	2,677,469.17
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-54,775,220.95	-3,635,594.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	450,490.03	848,609.95
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	10,781,808.12	5,464,453.70
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	92,143,266.21	-19,100,676.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		6,064,933.36	4,046,261.20
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	4,177,672.60	2,900,902.76
2.托管费	6.4.10.2.2	696,278.84	483,483.79
3.销售服务费	6.4.10.2.3	1,099,369.99	614,038.04
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7.税金及附加		177.69	6,542.00
8.其他费用	6.4.7.23	91,434.24	41,294.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		42,600,296.94	-19,094,913.37

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42,600,296.94	-19,094,913.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		42,600,296.94	-19,094,913.37

### 6.3 净资产变动表

会计主体：富达传承6个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	889,670,750.02	-111,375,621.62	778,295,128.40
二、本期期初净资产	889,670,750.02	-111,375,621.62	778,295,128.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-178,275,660.28	64,305,187.92	-113,970,472.36
（一）、综合收益总额	-	42,600,296.94	42,600,296.94
（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）	-178,275,660.28	21,704,890.98	-156,570,769.30
其中：1.基金申购款	57,912,550.91	-1,674,428.03	56,238,122.88
2.基金赎回款	-236,188,211.19	23,379,319.01	-212,808,892.18
（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	711,395,089.74	-47,070,433.70	664,324,656.04
项目	上年度可比期间		
	2023年04月25日（基金合同生效日）至2023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	1,078,680,628.44	-	1,078,680,628.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-19,094,913.37	-19,094,913.37
（一）、综合收益总额	-	-19,094,913.37	-19,094,913.37
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	1,078,680,628.44	-19,094,913.37	1,059,585,715.07

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:

XIAOYI HELEN HUANG

何湘

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

富达传承6个月持有期股票型证券投资基金(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]279号《关于准予富达传承6个月持有期股票型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《中华人民共和国证券投资基金法》和《富达传承6个月持有期股票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,本基金对每份基金份额设置6个月的最短持有期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,078,075,092.03元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第00120号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富达传承6个月持有期股票型证券投资基金基金合同》于2023年4月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,078,680,628.44份基金份额,其中认购资金利息折合605,536.41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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《富达传承6个月持有期股票型证券投资基金基金合同》和《富达传承6个月持有期股票型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《富达传承6个月持有期股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、央行票据、金融债、地方政府债券、公司债、企业债、政府支持机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、股指期货、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)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为80%-95%;港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和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、存出保证金和应收申购款等。股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×80% + 中证港股通综合指数收益率×10% + 中债-0-1年国债财富（总值）指数收益率×10%。

#### 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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 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。

#### 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会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化

个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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股票、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金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。

(2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)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 2024年06月30日	
	活期存款	1,513,845.72
等于：本金	1,513,744.94	
加：应计利息	100.78	
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	3,202,398.15	
等于：本金	3,202,185.93	
加：应计利息	212.22	
减：坏账准备	-	
合计	4,716,243.87	

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 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	583,651,129.23	-	606,231,572.20	22,580,442.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	39,906,280.00	615,540.98	40,639,540.98	117,720.00
	合计	39,906,280.00	615,540.98	40,639,540.98	117,720.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		623,557,409.23	615,540.98	646,871,113.18	22,698,162.97

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,060,120.60	-
银行间市场	-	-
合计	12,060,120.60	-

#### 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买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资



**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用-审计费	22,376.90
预提费用-信息披露费	59,672.34
预提费用-账户维护费	4,500.00
合计	86,549.24

### 6.4.7.10 实收基金

#### 6.4.7.10.1 富达传承6个月股票A

金额单位：人民币元

项目 (富达传承6个月股票A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	420,608,065.37	420,608,065.37
本期申购	54,397,893.18	54,397,893.18
本期赎回(以“-”号填列)	-134,868,196.30	-134,868,196.30
本期末	340,137,762.25	340,137,762.25

#### 6.4.7.10.2 富达传承6个月股票C

金额单位：人民币元

项目 (富达传承6个月股票C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	469,062,684.65	469,062,684.65
本期申购	3,514,657.73	3,514,657.73
本期赎回(以“-”号填列)	-101,320,014.89	-101,320,014.89
本期末	371,257,327.49	371,257,327.49

注: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。

### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

### 6.4.7.12 未分配利润

#### 6.4.7.12.1 富达传承6个月股票A

单位：人民币元

项目 (富达传承6个月股票 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-26,312,423.14	-25,543,534.57	-51,855,957.71
本期期初	-26,312,423.14	-25,543,534.57	-51,855,957.71
本期利润	-22,755,110.88	42,959,674.80	20,204,563.92
本期基金份额交易产生的变动数	9,174,680.23	1,147,613.59	10,322,293.82
其中：基金申购款	-6,032,074.45	4,629,175.81	-1,402,898.64
基金赎回款	15,206,754.68	-3,481,562.22	11,725,192.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-39,892,853.79	18,563,753.82	-21,329,099.97

## 6.4.7.12.2 富达传承6个月股票C

单位：人民币元

项目 (富达传承6个月股票 C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-31,075,758.32	-28,443,905.59	-59,519,663.91
本期期初	-31,075,758.32	-28,443,905.59	-59,519,663.91
本期利润	-26,787,858.39	49,183,591.41	22,395,733.02
本期基金份额交易产生的变动数	12,031,456.88	-648,859.72	11,382,597.16
其中：基金申购款	-435,672.54	164,143.15	-271,529.39
基金赎回款	12,467,129.42	-813,002.87	11,654,126.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-45,832,159.83	20,090,826.10	-25,741,333.73

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	3,153.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,623.86
结算备付金利息收入	8,752.50
其他	-
合计	15,529.73

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。

#### 6.4.7.14 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	652,945,499.50
减：卖出股票成本总额	706,166,333.03
减：交易费用	1,554,387.42
买卖股票差价收入	-54,775,220.95

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	402,088.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	48,401.11
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	450,490.03

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	61,087,647.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	59,947,558.89
减：应计利息总额	1,091,237.70
减：交易费用	450.00
买卖债券差价收入	48,401.11

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	10,781,808.12
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,781,808.12

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	92,143,266.21
——股票投资	92,059,557.32
——债券投资	83,708.89
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	92,143,266.21

**6.4.7.21 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	385.00
账户维护费_中债登	9,000.00
合计	91,434.24

**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
富达亚洲控股私人有限公司	基金管理人的股东
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间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 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年04月25日（基金合同 生效日）至2023年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,177,672.60	2,900,902.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,979,648.92	1,346,891.99
应支付基金管理人的净管理费	2,198,023.68	1,554,010.77

注：根据《富达基金管理（中国）有限公司关于调低富达传承6个月持有期股票型证券投资基金费率并修订基金合同的公告》的规定，自2023年12月1日起，本基金的年管理费率由1.50%调整为1.20%。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元



项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年04月25日（基金合同生效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	696,278.84	483,483.79

注：根据《富达基金管理（中国）有限公司关于调低富达传承6个月持有期股票型证券投资基金费率并修订基金合同的公告》的规定，自2023年12月1日起，本基金的基金托管费由0.25%年费率调整为0.20%年费率。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富达传承6个月股票A	富达传承6个月股票C	合计
中国银行	-	197,716.08	197,716.08
富达基金	-	2,688.28	2,688.28
合计	-	200,404.36	200,404.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年04月25日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富达传承6个月股票A	富达传承6个月股票C	合计
中国银行	-	95,757.43	95,757.43
富达基金	-	1,075.81	1,075.81
合计	-	96,833.24	96,833.24

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金份额的基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间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**

本基金本报告期及上年度可比期间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**

本基金本报告期及上年度可比期间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**

本基金管理人本报告期内及上年度可比期间均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**

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年04月25日（基金合同生效日） 至2023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
中国银行	1,513,845.72	3,153.37	210,526.48	58,406.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间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**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### **6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券**

##### **6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/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**

本基金本报告期末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**

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。本基金投资目标是在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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中国银行，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。

于2024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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	40,639,540.98	-
合计	40,639,540.98	-

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）未评级债券为政策性金融债等无信用评级的债券。

#### 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2024年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《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、结算备付金、交易性金融资产及买入返售金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,716,243.87	-	-	-	4,716,243.87
结算备付金	9,754.18	-	-	-	9,754.18
交易性金融资产	40,639,540.98	-	-	606,231,572.20	646,871,113.18
买入返售金融资产	12,060,120.60	-	-	-	12,060,120.60
应收清算款	-	-	-	3,705,880.55	3,705,880.55
应收股利	-	-	-	2,544,617.72	2,544,617.72
应收申购款	-	-	-	25,828.45	25,828.45
资产总计	57,425,659.63	-	-	612,507,898.92	669,933,558.55
负债					
应付清算款	-	-	-	1,947,705.39	1,947,705.39

应付赎回款	-	-	-	2,615,029.46	2,615,029.46
应付管理人报酬	-	-	-	672,379.93	672,379.93
应付托管费	-	-	-	112,063.34	112,063.34
应付销售服务费	-	-	-	175,011.12	175,011.12
应交税费	-	-	-	164.03	164.03
其他负债	-	-	-	86,549.24	86,549.24
负债总计	-	-	-	5,608,902.51	5,608,902.51
利率敏感度缺口	57,425,659.63	-	-	606,898,996.41	664,324,656.04
上年度末 2023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	6,882,803.07	-	-	-	6,882,803.07
结算备付金	1,001.68	-	-	-	1,001.68
交易性金融资产	50,971,452.06	-	-	711,725,830.48	762,697,282.54
买入返售金融资产	16,517,297.87	-	-	-	16,517,297.87
应收申购款	-	-	-	13,937.79	13,937.79

资产总计	74,372,554.68	-	-	711,739,768.27	786,112,322.95
负债					
应付清算款	-	-	-	4,447,532.04	4,447,532.04
应付赎回款	-	-	-	2,088,996.22	2,088,996.22
应付管理人报酬	-	-	-	798,878.77	798,878.77
应付托管费	-	-	-	133,146.47	133,146.47
应付销售服务费	-	-	-	210,802.60	210,802.60
应交税费	-	-	-	1,338.45	1,338.45
其他负债	-	-	-	136,500.00	136,500.00
负债总计	-	-	-	7,817,194.55	7,817,194.55
利率敏感度缺口	74,372,554.68	-	-	703,922,573.72	778,295,128.40

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年06月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为6.12%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
----	--------------------



	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	192,859,437.58	-	192,859,437.58
应收股利	-	2,544,617.72	-	2,544,617.72
资产合计	-	195,404,055.30	-	195,404,055.30
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	195,404,055.30	-	195,404,055.30
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	112,082,714.18	-	112,082,714.18
资产合计	-	112,082,714.18	-	112,082,714.18
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	112,082,714.18	-	112,082,714.18

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除港币以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响 金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	港币相对人民币升值 5%	9,770,202.77	5,604,135.71
	港币相对人民币贬值 5%	-9,770,202.77	-5,604,135.71

### 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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，以识别和测算本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	606,231,572.20	91.26	711,725,830.48	91.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	40,639,540.98	6.12	50,971,452.06	6.55
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	646,871,113.18	97.37	762,697,282.54	98.00

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	31,083,600.79	31,580,468.54
	业绩比较基准下降5%	-31,083,600.79	-31,580,468.54

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	606,231,572.20	711,725,830.48
第二层次	40,639,540.98	50,971,452.06
第三层次	-	-
合计	646,871,113.18	762,697,282.54

###### 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股票和债券，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股票和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，确定相关股票和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	606,231,572.20	90.49
	其中：股票	606,231,572.20	90.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,639,540.98	6.07
	其中：债券	40,639,540.98	6.07
	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	12,060,120.60	1.80
	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	4,725,998.05	0.71
8	其他各项资产	6,276,326.72	0.94
9	合计	669,933,558.55	100.00

注：报告期末本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值合计192,859,437.58元，占基金资产净值的比例为29.03%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	68,092,497.00	10.25
C	制造业	282,833,382.47	42.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,436,023.15	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	10,775,084.00	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	28,036,200.00	4.22
K	房地产业	5,713,272.00	0.86
L	租赁和商务服务业	6,487,836.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,997,840.00	0.60
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	413,372,134.62	62.22

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
原材料	3,316,423.57	0.50
非日常生活消费品	28,794,123.07	4.33
日常消费品	8,178,708.02	1.23
能源	79,891,608.07	12.03

金融	4,895,250.45	0.74
医疗保健	6,453,815.83	0.97
工业	29,004,450.18	4.37
信息技术	9,772,872.48	1.47
通讯业务	16,175,619.31	2.43
房地产	6,376,566.60	0.96
合计	192,859,437.58	29.03

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00883	中国海洋石油	2,046,000	41,828,489.47	6.30
2	601225	陕西煤业	1,173,700	30,246,249.00	4.55
3	601088	中国神华	532,100	23,609,277.00	3.55
4	000333	美的集团	309,300	19,949,850.00	3.00
5	03668	兖煤澳大利亚	555,600	17,316,953.02	2.61
6	600885	宏发股份	572,722	15,852,944.96	2.39
7	601899	紫金矿业	810,300	14,236,971.00	2.14
8	00857	中国石油股份	1,882,000	13,569,543.70	2.04
9	00696	中国民航信息网络	1,593,000	13,317,717.04	2.00
10	00700	腾讯控股	38,000	12,915,517.22	1.94
11	601126	四方股份	624,100	11,995,202.00	1.81
12	601601	中国太保	428,100	11,926,866.00	1.80
13	002372	伟星新材	760,086	11,720,526.12	1.76
14	300628	亿联网络	293,300	10,784,641.00	1.62

15	601006	大秦铁路	1,504,900	10,775,084.00	1.62
16	002475	立讯精密	271,800	10,684,458.00	1.61
17	688268	华特气体	202,898	10,471,565.78	1.58
18	002831	裕同科技	394,800	10,102,932.00	1.52
19	603501	韦尔股份	95,175	9,457,539.75	1.42
20	600585	海螺水泥	398,100	9,391,179.00	1.41
21	002444	巨星科技	369,900	9,136,530.00	1.38
22	002508	老板电器	413,300	9,133,930.00	1.37
23	601600	中国铝业	1,155,100	8,813,413.00	1.33
24	600875	东方电气	473,100	8,728,695.00	1.31
25	300979	华利集团	140,600	8,555,510.00	1.29
26	03808	中国重汽	458,500	8,494,814.73	1.28
27	603596	伯特利	212,940	8,283,366.00	1.25
28	00168	青岛啤酒股份	172,000	8,178,708.02	1.23
29	02039	中集集团	1,224,500	7,867,739.69	1.18
30	600660	福耀玻璃	156,400	7,491,560.00	1.13
31	600183	生益科技	353,500	7,444,710.00	1.12
32	603939	益丰药房	302,893	7,436,023.15	1.12
33	600036	招商银行	216,200	7,391,878.00	1.11
34	600019	宝钢股份	1,109,620	7,378,973.00	1.11
35	00386	中国石油化工股份	1,554,000	7,176,621.88	1.08
36	002415	海康威视	223,900	6,920,749.00	1.04
37	002003	伟星股份	547,700	6,873,635.00	1.03
38	600584	长电科技	215,800	6,843,018.00	1.03
39	603899	晨光股份	216,085	6,759,138.80	1.02
40	02382	舜宇光学科技	150,900	6,645,154.63	1.00
41	00038	第一拖拉机股份	980,000	6,609,811.10	0.99

42	002027	分众传媒	1,070,600	6,487,836.00	0.98
43	06078	海吉亚医疗	251,200	6,453,815.83	0.97
44	601318	中国平安	155,800	6,443,888.00	0.97
45	00688	中国海外发展	516,000	6,376,566.60	0.96
46	000786	北新建材	211,600	6,276,056.00	0.94
47	601100	恒立液压	132,600	6,176,508.00	0.93
48	01929	周大福	798,000	6,154,292.51	0.93
49	605099	共创草坪	324,264	6,131,832.24	0.92
50	603345	安井食品	82,248	6,111,848.88	0.92
51	03311	中国建筑国际	620,000	6,032,084.66	0.91
52	603986	兆易创新	62,287	5,955,882.94	0.90
53	600761	安徽合力	273,500	5,918,540.00	0.89
54	300037	新宙邦	203,200	5,803,392.00	0.87
55	600048	保利发展	652,200	5,713,272.00	0.86
56	02020	安踏体育	82,800	5,667,742.80	0.85
57	01299	友邦保险	101,200	4,895,250.45	0.74
58	603833	欧派家居	91,100	4,879,316.00	0.73
59	603187	海容冷链	413,600	4,822,576.00	0.73
60	600563	法拉电子	62,600	4,768,868.00	0.72
61	000526	学大教育	64,900	3,997,840.00	0.60
62	00027	银河娱乐	110,000	3,654,370.72	0.55
63	00189	东岳集团	428,000	3,316,423.57	0.50
64	01024	快手-W	77,400	3,260,102.09	0.49
65	600887	伊利股份	124,400	3,214,496.00	0.48
66	00968	信义光能	872,000	3,127,717.85	0.47
67	300059	东方财富	215,300	2,273,568.00	0.34

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细



金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00688	中国海外发展	21,185,181.94	2.72
2	03668	兖煤澳大利亚	21,145,659.48	2.72
3	00857	中国石油股份	18,132,096.78	2.33
4	600048	保利发展	14,795,234.44	1.90
5	601939	建设银行	13,774,617.30	1.77
6	600585	海螺水泥	13,306,733.00	1.71
7	601006	大秦铁路	11,000,027.41	1.41
8	601601	中国太保	10,557,965.00	1.36
9	688268	华特气体	10,488,899.90	1.35
10	300628	亿联网络	10,268,907.80	1.32
11	600941	中国移动	10,180,426.00	1.31
12	000526	学大教育	9,741,631.00	1.25
13	600690	海尔智家	9,486,548.00	1.22
14	603833	欧派家居	9,172,739.08	1.18
15	601600	中国铝业	9,158,198.50	1.18
16	02039	中集集团	8,694,733.82	1.12
17	09979	绿城管理控股	8,662,974.31	1.11
18	600875	东方电气	8,386,149.00	1.08
19	601225	陕西煤业	8,264,251.00	1.06
20	00696	中国民航信息网络	8,058,412.00	1.04

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例(%)
1	600519	贵州茅台	24,720,495.00	3.18
2	600585	海螺水泥	20,911,710.14	2.69
3	600048	保利发展	17,640,506.00	2.27
4	600779	水井坊	16,347,506.32	2.10
5	601225	陕西煤业	16,197,520.75	2.08
6	00883	中国海洋石油	14,967,751.05	1.92
7	601899	紫金矿业	14,899,614.87	1.91
8	601939	建设银行	14,602,971.00	1.88
9	600031	三一重工	12,848,237.96	1.65
10	002371	北方华创	12,661,824.90	1.63
11	03690	美团-W	12,340,869.09	1.59
12	00688	中国海外发展	11,861,901.79	1.52
13	600690	海尔智家	11,438,182.63	1.47
14	00857	中国石油股份	10,891,742.78	1.40
15	600276	恒瑞医药	10,548,188.64	1.36
16	600941	中国移动	10,473,322.14	1.35
17	09979	绿城管理控股	10,223,159.60	1.31
18	601088	中国神华	9,981,712.00	1.28
19	301345	涛涛车业	9,808,095.65	1.26
20	300760	迈瑞医疗	9,511,833.00	1.22

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	508,612,517.43
卖出股票收入（成交）总额	652,945,499.50

注：买入股票成本总额、卖出股票收入总额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,639,540.98	6.12
	其中：政策性金融债	40,639,540.98	6.12
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	40,639,540.98	6.12

#### 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	230211	23国开11	400,000	40,639,540.98	6.12

#### 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适度参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将有选择地投资于流动性好、

交易活跃的股指期货合约，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则适度参与国债期货投资。本基金在进行国债期货投资中，将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲风险，并且利用国债期货的杠杆作用，达到降低投资组合整体风险的目的。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

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 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

### 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	3,705,880.55
3	应收股利	2,544,617.72
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,828.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,276,326.72

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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
富达传承6个月股票A	5,105	66,628.36	52,342,931.72	15.39%	287,794,830.53	84.61%
富达传承6个月股票C	12,517	29,660.25	8,350,106.60	2.25%	362,907,220.89	97.75%
合计	17,622	40,369.71	60,693,038.32	8.53%	650,702,051.42	91.47%

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	富达传承6个月股票A	11,453,494.23	3.3673%

	富达传承6个月股票C	2,527,991.74	0.6809%
	合计	13,981,485.97	1.9654%

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	富达传承6个月股票A	>100
	富达传承6个月股票C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	富达传承6个月股票A	0
	富达传承6个月股票C	>100
	合计	>100

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	富达传承6个月股票A	富达传承6个月股票C
基金合同生效日(2023年04月25日)基金份额总额	507,722,859.55	570,957,768.89
本报告期期初基金份额总额	420,608,065.37	469,062,684.65
本报告期基金总申购份额	54,397,893.18	3,514,657.73
减：本报告期基金总赎回份额	134,868,196.30	101,320,014.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	340,137,762.25	371,257,327.49

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无重大人事变动。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
中信证券(山东)	2	469,671,837.56	40.43%	349,120.67	39.71%	-
中信证券	4	691,886,179.37	59.57%	530,084.85	60.29%	-

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、根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。

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
中信证券(山东)	-	-	225,130,000.00	37.04%	-	-	-	-
中信证券	-	-	382,624,000.00	62.96%	-	-	-	-

### 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）有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-29
2	富达传承6个月持有期股票型证券投资基金A类份额基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-06-06
3	富达传承6个月持有期股票型证券投资基金C类份额基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-06-06
4	富达传承6个月持有期股票型证券投资基金更新招募说明书	中国证监会规定媒介	2024-06-06

## §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

本报告期内本基金未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §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批准募集文件
- 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

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

## 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  
二〇二四年八月三十日