富安达中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 28 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年3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经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2025年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§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遵规守信情况的说明 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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.9 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遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 审计报告 15
6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 20
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 50
8.1 期末基金资产组合情况 50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 51
8.3 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 51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 52
8.6 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 52
8.7 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 53
8.8 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 53
8.9 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 53
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 53

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 53
8.12 投资组合报告附注 53
§9 基金份额持有人信息 54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 55
9.3 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 55
§10 开放式基金份额变动 55
§11 重大事件揭示 55
11.1 基金份额持有人大会决议 55
11.2 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
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
11.4 基金投资策略的改变 56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 56
11.8 其他重大事件 62
§12 影响投资者决策的其他重要信息 68
12.1 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 68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 68
§13 备查文件目录 68
13.1 备查文件目录 68
13.2 存放地点 69
13.3 查阅方式 69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
基金简称	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	018348
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年06月14日
基金管理人	富安达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,696,878.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资，力争在扣除各项费用前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
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，以实现对标的指数的有效跟踪。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0.20%，将年化跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。 本基金运作过程中，如果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，基金管理人将按照基金份额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。

业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成分券及备选成分券，具有与标的指数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		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李理想	方圆
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道1568号29楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1568号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		王胜	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址

会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025年	2024年	2023年06月14日（基金合同生效日）-2023年12月31日
本期已实现收益	222,552.37	645,957.89	2,299,059.29
本期利润	212,393.31	637,607.28	2,315,635.29
加权平均基金份额本期利润	0.0093	0.0151	0.0081
本期加权平均净值利润率	0.90%	1.49%	0.81%
本期基金份额净值增长率	0.92%	1.55%	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	2024年末	2023年末
期末可供分配利润	524,006.99	1,280,836.37	331,370.65
期末可供分配基金份额利润	0.0314	0.0215	0.0059
期末基金资产净值	17,247,472.44	61,045,811.32	57,033,480.30
期末基金份额净值	1.0330	1.0236	1.0080
3.1.3 累计期末指标	2025年末	2024年末	2023年末
基金份额累计净值增长率	3.30%	2.36%	0.80%

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。

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

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	0.25%	0.01%	0.41%	0.01%	-0.16%	0.00%
过去六个月	0.43%	0.01%	0.81%	0.01%	-0.38%	0.00%
过去一年	0.92%	0.01%	1.64%	0.01%	-0.72%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.30%	0.01%	5.22%	0.01%	-1.92%	0.00%

注：

1．本基金业绩比较基准为中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%

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：

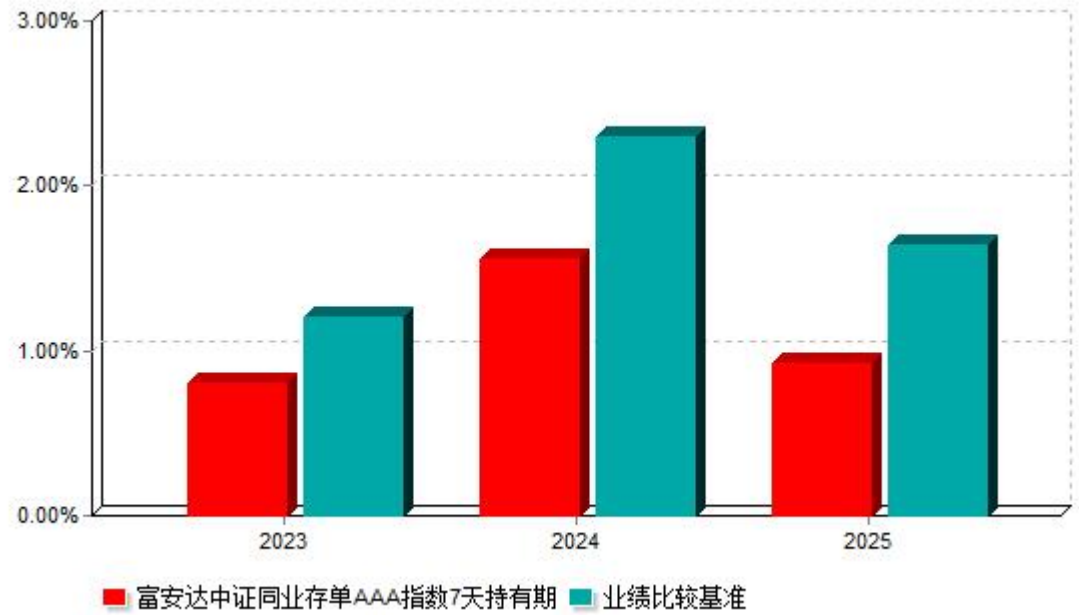
Return t =95%×[中证同业存单AAA指数收益率t÷中证同业存单AAA指数收益率(t-1)-1]+5%×[银行人民币活期存款利率（税后)t÷银行人民币活期存款利率（税后)(t-1)-1]+

Benchmark t =(1+ Return t)×Benchmark(t-1)

其中，t =1，2，3，...T，T 表示时间截至日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2023年6月14日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2023年6月14日，自基金合同生效以来至本报告期末未实施利润分配。

§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2025年12月31日，公司共管理二十八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		
孙辰旸	本基金的基金经理	2023-12-08	-	11年	硕士。历任富安达资产管理（上海）有限公司产品设计专员；2016年加入富安达基金管理有限公司任交易员、债券研究员兼投资经理、富安达现金通货币市场证券投资基金的基金经理助理、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理助理。现任富安达现金通货币市场证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、富安达神州天添利货币市场基金的基金

					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；基金管理人于2026年2月27日发布公告，孙辰旸自2026年2月26日不再担任本基金基金经理。

2.证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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

2025年，债市结束了此前连续两年的快速单边下行行情，在政策博弈、中美关税战、股债跷跷板效应等三大主线驱动下，全年10年期国债收益率绝大部分时间都在1.6%－1.9%的区间内反复震荡。

具体而言，开年债市延续上年末的抢跑行情，10年期国债收益率在年初一度下破1.6%。随后央行通过暂停国债买卖、引导资金面收敛等方式旨在遏制利率过快下行的风险。春节后A股在DeepSeek和人形机器人等主线带动下走强，同时降准降息落空也使得长端抱团瓦解，收益率由短及长调整。10年期国债收益率在3月中旬上行至年内高点1.9%。中旬后，央行恢复公开市场净投放，MLF超量续作叠加股市调整，债市情绪开始转暖。4月初美国“对等关税”实施，避险情绪推动10年期国债收益率快速探底后，在1.65%附近持续震荡。5月降准降息落地，此后市场围绕各类消息面展开多空博弈，10年期国债收益率基本在1.6%－1.7%区间窄幅震荡。进入三季度，外围扰动减弱，在反内卷政策、雅鲁藏布江水电站开工等消息刺激下，股债跷跷板效应再次凸显。同时公募基金销售新规（征求意见稿）引发债基赎回担忧，加剧了债市的调整压力。10年期国债收益率在9月末再次触及1.9%。10月关税摩擦再起，叠加月末央行宣布重启买债，债市情绪有所修复。但随后购债规模不及预期，乐观情绪消退。超长债收益率在信用风险事件冲击、超长债供给与公募基金销售新规（征求意见稿）的担忧以及赎回扰动中震荡上行，中短端受益于流动性宽松表现相对抗跌，收益率曲线呈现熊陡形态。截至2025年12月31日，1年期、10年期、30年期国债收益率分别收于1.34％、1.85％、2.27％，较年初分别上行25BP、17BP、36BP。1年期AAA存单收益率由年初的1.575%上行5BP至年末的1.625%。

流动性方面，2025年资金面整体呈现出前紧后松，资金利率中枢逐季下行的特征。开年后在央行的有意引导下资金面显著收敛，DR001加权平均利率最高达到1.97%，大幅高于政策利率水平。美国实施“对等关税”后，为支持国内经济，央行货币政策宽松加码，此后银行间流动性整体维持充裕。降息后DR001加权平均利率围绕政策利率波动的趋势较为显著。2025年，DR001和DR007年加权平均利率分别为1.46%和1.63%，较2024年下行幅度均为19BP。

报告期内，本基金通过采用抽样复制指数与动态优化相结合的方法，主要投资于中证AAA同业存单指数的成份券和备选成份券，并综合运用久期策略、骑乘策略、票息策略和杠杆策略等来增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达中证同业存单AAA指数7天持有期基金份额净值为1.0330元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.92%，同期业绩比较基准收益率为1.64%。

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年是“十五五”开局之年，根据中央经济工作会议精神，宏观总量政策保持平稳，财政政策在支出结构和“两重两新”上进行优化；货币政策延续适度宽松基调，灵活高效运用降准降息工具。央行开年进行结构性降息，公开市场操作积极，并表示年内预期降准降息还有一定空间。政策着力点依然围绕新质生产力和扩大内需展开，同时兼顾其他。“反内卷”继续深入推进，房地产限购政策进一步松绑，通胀预期CPI低水平上涨，PPI降幅缩窄，年内有回正可能性。

2026年市场关注点依然侧重权益与商品市场，海外美联储政策与地缘政治因素对于大类资产走势也会有实质性影响，债券整体可能仍缺乏趋势性机会。短期关注央行货币政策、债券供需情况以及总量政策发力节奏，中期需关注“反内卷”下通胀改善情况。

2025年面对低利率环境与净息差压力，银行优化负债结构、降低融资成本的诉求尤为迫切，有赖于央行的流动性支持，年内同业存单余额下降明显，且短期化发行趋势显著。近年来，央行对于银行间市场流动性的掌控能力明显提升，资金利率波动率大幅下降，在此背景下，2026年同业存单市场“低波动”的特征有望延续，利率走势取决于宏观经济走势与央行货币政策取向。

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回报。持续跟踪国内外宏观经济情况、资金面变化以及市场行情，结合基金负债端特点，围绕中证AAA同业存单指数的成份券及备选成份券进行配置，灵活调整组合资产分布、久期和杠杆，做好安全性、流动性和收益性之间的平衡。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人持续推进内控体系和机制建设，强化内部管理，不断提升自身合规风控能力。报告期内，公司进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，强化内控基础建设；牵头开展了多形式的合规培训，强化员工职业道德教育和合规意识培育，从源头上防范合规风险；建立健全防控内幕交易机制，确保基金投资的独立性、公平性和合规性；加强业务日常合规审核和合规监测，并加大对重要业务和关键业务环节的监督检查，确保各项法规和管理制度有效落实，使业务在可稽可控的范围内有序开展。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全全面风险管理体系，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保护基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金曾存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。针对该情形，本基金管理人的解决方案为：稳健运作，做好基金业绩，稳定基金规模；积极沟通，整合资源，有序推进营销工作。上述方案已按《公开募集证券投资基金运作管理办法》要求向中国证监会备案并落实解决措施。

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2600218号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了后附的富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金(以下简称"该基金") 财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表、2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称"企业会计准则"） 及财务报表附注[7.4.2]中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称"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编制，公允反映了该基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度

	的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称"审计准则"）的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第1号--财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人富安达基金管理有限公司（以下简称"该基金管理人"）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2025年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2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

	务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的

	审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	虞京京	楚济铭
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2026-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	1,285,554.58	2,007,372.80
结算备付金		12,754.29	-
存出保证金		1,639.47	-
交易性金融资产	7.4.7.2	16,471,806.52	36,380,442.10
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		16,471,806.52	36,380,442.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	16,003,591.69
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	6,689,766.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		17,771,754.86	61,081,173.04
负债和净资产	**附注号**	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-108.25	-
应付清算款		500,297.60	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		2,806.31	4,072.43
应付托管费		701.58	1,018.10
应付销售服务费		2,806.31	4,072.43
应付投资顾问费		-	-
应交税费		77.42	110.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	17,701.45	26,088.00
负债合计		524,282.42	35,361.72
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	16,696,878.79	59,639,111.72
未分配利润	7.4.7.8	550,593.65	1,406,699.60
净资产合计		17,247,472.44	61,045,811.32
负债和净资产总计		17,771,754.86	61,081,173.04

注： 报告截止日2025年12月31日，基金份额净值1.0330元，基金份额总额16,696,878.79份。

7.2 利润表

会计主体：富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
一、营业总收入		384,484.65	966,924.81
1.利息收入		36,316.57	49,890.17
其中：存款利息收入	7.4.7.9	10,879.38	12,785.65
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		25,437.19	37,104.52

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		358,327.14	925,385.25
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	-
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	358,327.14	925,385.25
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,159.06	-8,350.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、营业总支出		172,091.34	329,317.53
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	47,227.75	88,283.57
2.托管费	7.4.10.2.2	11,806.92	22,070.85
3.销售服务费	7.4.10.2.3	47,227.75	88,283.57
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		14,542.64	74,937.47
其中：卖出回购金融资产支出		14,542.64	74,937.47
6.信用减值损失	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		173.67	542.07
8.其他费用	7.4.7.20	51,112.61	55,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		212,393.31	637,607.28

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		212,393.31	637,607.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		212,393.31	637,607.28

7.3 净资产变动表

会计主体：富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	59,639,111.72	1,406,699.60	61,045,811.32
二、本期期初净资产	59,639,111.72	1,406,699.60	61,045,811.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-42,942,232.93	-856,105.95	-43,798,338.88
（一）、综合收益总额	-	212,393.31	212,393.31
（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）	-42,942,232.93	-1,068,499.26	-44,010,732.19
其中：1.基金申购款	130,793,531.09	3,674,078.33	134,467,609.42
2.基金赎回款	-173,735,764.02	-4,742,577.59	-178,478,341.61
（三）、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	16,696,878.79	550,593.65	17,247,472.44
项 目	**上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	56,579,636.50	453,843.80	57,033,480.30
二、本期期初净资产	56,579,636.50	453,843.80	57,033,480.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,059,475.22	952,855.80	4,012,331.02
（一）、综合收益总额	-	637,607.28	637,607.28
（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）	3,059,475.22	315,248.52	3,374,723.74
其中：1.基金申购款	310,319,349.53	4,012,209.81	314,331,559.34
2.基金赎回款	-307,259,874.31	-3,696,961.29	-310,956,835.60
（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	59,639,111.72	1,406,699.60	61,045,811.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金（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]671号《关于准予富安达中证同业存单AAA指数7天持有期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《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期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999,955,878.87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0342号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》于2023年6月14日生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,000,090,201.55份基金份额，其中认购资金利息折合134,322.68份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《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《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》等法律文件约定，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其他同业存单、债券（含国债、央行票据、政策性金融债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券等）、非金融企业债务融资工具（中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具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。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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的80%，本基金投资于标的指数成份券及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：中证同业存单AAA 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

7.4.2 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《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》及财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

7.4.3 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7.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况、2025年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

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

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

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

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

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

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

(b) 金融负债的分类

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

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

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

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

公允价值变动收益

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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》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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	1,285,554.58	2,007,372.80
等于：本金	1,285,453.89	2,007,109.49
加：应计利息	100.69	263.31
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	1,285,554.58	2,007,372.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	1,198,700.00	13,386.08	1,213,386.08	1,300.00
	银行间市场	15,107,173.67	154,480.44	15,258,420.44	-3,233.67
	合计	16,305,873.67	167,866.52	16,471,806.52	-1,933.67
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		16,305,873.67	167,866.52	16,471,806.52	-1,933.67
项目		上年度末 2024年12月31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	-	-	-	-
	银行间市场	35,856,874.61	515,342.10	36,380,442.10	8,225.39
	合计	35,856,874.61	515,342.10	36,380,442.10	8,225.39
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		35,856,874.61	515,342.10	36,380,442.10	8,225.39

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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

	2025年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	16,003,591.69	-
合计	16,003,591.69	-

7.4.7.4.2 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及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31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	3,687.75	8,088.00
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	3,687.75	8,088.00
应付利息	-	-
应付审计费用	14,013.70	18,000.00
合计	17,701.45	26,088.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,639,111.72	59,639,111.72
本期申购	130,793,531.09	130,793,531.09
本期赎回（以“-”号填列）	-173,735,764.02	-173,735,764.02
本期末	16,696,878.79	16,696,878.79

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

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
上年度末	1,280,836.37	125,863.23	1,406,699.60
本期期初	1,280,836.37	125,863.23	1,406,699.60
本期利润	222,552.37	-10,159.06	212,393.31
本期基金份额交易产生的变动数	-979,381.75	-89,117.51	-1,068,499.26
其中：基金申购款	3,381,185.10	292,893.23	3,674,078.33
基金赎回款	-4,360,566.85	-382,010.74	-4,742,577.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	524,006.99	26,586.66	550,593.65

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	10,738.44	12,585.65
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	139.20	-
其他	1.74	200.00
合计	10,879.38	12,785.65

注：其他为应收申购款利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.11 基金投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	393,562.21	1,077,057.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-35,235.07	-151,671.91
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	358,327.14	925,385.25

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出债券（债转股	134,770,375.85	202,244,144.88

及债券到期兑付）成交总额		
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	132,956,776.37	198,644,952.51
减：应计利息总额	1,836,817.05	3,730,551.78
减：交易费用	12,017.50	20,312.50
买卖债券差价收入	-35,235.07	-151,671.91

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	-10,159.06	-8,350.61
——股票投资	-	-
——债券投资	-10,159.06	-8,350.61
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	-10,159.06	-8,350.61

7.4.7.18 其他收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
审计费用	14,013.70	18,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
账户维护费	35,898.91	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	51,112.61	55,200.00

注：自2025年9月30日至2025年10月23日止期间，由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
富安达资产管理（上海）有限公司("富安达资管")	基金管理人的全资子公司
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司("南京河西")	基金管理人的股东
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
江苏云杉资本管理有限公司("江苏云杉")	基金管理人的股东

注：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，下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
南京证券	37,483,402.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
南京证券	74,230,000.00	100.00%	-	-

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	47,227.75	88,283.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	12,977.87	27,367.28
应支付基金管理人的净管理费	34,249.88	60,916.29

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0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,806.92	22,070.85

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2025年01月01日至2025年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
交通银行	7,759.78
南京证券	16,337.89
富安达基金	14,357.16
合计	38,454.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
交通银行	21,864.29
南京证券	39,688.36
富安达基金	20,860.09
合计	82,412.74

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：销售服务费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未发生投资本基金的情况。

7.4.10.6 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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,285,554.58	10,738.44	2,007,372.80	12,585.65

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2025年12月31日的相关余额为人民币12,754.29元。（2024年12月31日：人民币0.00元）

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期内未进行过利润分配。（2024年：无）

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2025年12月31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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2025年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2025年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年12月31日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额-108.25元，于2025年12月31日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2025年12月31日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只主动管理型混合型基金，风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成分券及备选成分券，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金采用指数化投资，力争在扣除各项费用前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

7.4.13.2.1 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,213,386.08	1,529,778.69
合计	1,213,386.08	1,529,778.69

注：未评级债券为国债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	14,230,636.88	32,827,652.45
合计	14,230,636.88	32,827,652.45

注：未评级部分为主体评级AAA的同业存单。

7.4.13.2.3 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	1,027,783.56	2,023,010.96
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,027,783.56	2,023,010.96

7.4.13.3 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在满足持有期限要求后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2025年12月31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。

7.4.13.3.1 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发行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7.4.12。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10%。于2025年12月31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2025年12月31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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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	1,285,554.58	-	-	-	1,285,554.58
结算备付金	12,754.29	-	-	-	12,754.29
存出保证金	1,639.47	-	-	-	1,639.47
交易性金融资产	16,471,806.52	-	-	-	16,471,806.52
资产总计	17,771,754.86	-	-	-	17,771,754.86
负债					
卖出回购金融资产款	-108.25	-	-	-	-108.25
应付清算款	-	-	-	500,297.60	500,297.60
应付管理人报酬	-	-	-	2,806.31	2,806.31
应付托管费	-	-	-	701.58	701.58
应付销	-	-	-	2,806.31	2,806.31

售服务费					
应交税费	-	-	-	77.42	77.42
其他负债	-	-	-	17,701.45	17,701.45
负债总计	-108.25	-	-	524,390.67	524,282.42
利率敏感度缺口	17,771,863.11	-	-	-524,390.67	17,247,472.44
上年度末2024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	2,007,372.80	-	-	-	2,007,372.80
交易性金融资产	36,380,442.10	-	-	-	36,380,442.10
买入返售金融资产	16,003,591.69	-	-	-	16,003,591.69
应收申购款	-	-	-	6,689,766.45	6,689,766.45
资产总计	54,391,406.59	-	-	6,689,766.45	61,081,173.04
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,072.43	4,072.43
应付托管费	-	-	-	1,018.10	1,018.10
应付销售服务费	-	-	-	4,072.43	4,072.43

应交税费	-	-	-	110.76	110.76
其他负债	-	-	-	26,088.00	26,088.00
负债总计	-	-	-	35,361.72	35,361.72
利率敏感度缺口	54,391,406.59	-	-	6,654,404.73	61,045,811.32

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	12,064.47	30,342.06
	2.市场利率上升25个基点	-12,042.02	-30,267.75

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	16,471,806.52	36,380,442.10
第三层次	-	-
合计	16,471,806.52	36,380,442.10

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2024年12月31日：无)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2025年12月31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。

§8 投资组合报告

8.1 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	16,471,806.52	92.69
	其中：债券	16,471,806.52	92.69
	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	1,298,308.87	7.31
8	其他各项资产	1,639.47	0.01
9	合计	17,771,754.86	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）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。

8.2.2 报告期末（积极投资）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。

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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。

8.3.2 期末积极投资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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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。

8.4.2 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。

8.4.3 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。

8.5 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	1,213,386.08	7.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,027,783.56	5.96
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	14,230,636.88	82.51
9	其他	-	-
10	合计	16,471,806.52	95.50

8.6 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	112520111	25广发银行CD111	15,000	1,497,541.88	8.68
2	112508368	25中信银行CD3	15,000	1,496,543.14	8.68

		68			
3	112504023	25中国银行CD023	15,000	1,490,375.70	8.64
4	112522027	25邮储银行CD027	13,000	1,288,738.99	7.47
5	019766	25国债01	12,000	1,213,386.08	7.04

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，中信银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、恒丰银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金管理人在遵守法律法规和公司管理制度的前提下进行指数投资。整个过程中严格履行了相关的投资决策程序。

8.12.2 本基金本报告期末未持有股票投资。

8.12.3 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	1,639.47
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,639.47

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资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。

8.12.5.2 期末积极投资前五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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
201	83,069.05	8,677,441.62	51.97%	8,019,437.17	48.03%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	766.41	0.00%

9.3 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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0~10万份。

2．本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0~10万份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年06月14日)基金份额总额	1,000,090,201.55
本报告期期初基金份额总额	59,639,111.72
本报告期基金总申购份额	130,793,531.09
减：本报告期基金总赎回份额	173,735,764.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	16,696,878.79

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，孟羽任交通银行资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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）。

报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为14013.70元人民币。

截至本报告期末，该事务所已提供审计服务的连续年限为3年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人未受到调查或处罚。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人的相关从业人员未受到任何调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数	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	

	量					
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-

公司						
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛	2	-	-	-	-	-

证券						
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风	2	-	-	-	-	-

证券						
西部证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	3	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-

注：

1、交易单元的选择标准和程序：

我公司制定了选择券商的标准，即：

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

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

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

（4）能为公司提供高质量的研究服务；基金管理人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，(55268、012297)恒泰证券、(63206、001039)爱建证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：(55327、000127)大同证券、(20697)银河证券、(56756、016016)首创证券、(59740)德邦证券。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本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）的报告期为2025年1月1日至2025年12月31日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

11.7.2 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
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	37,483,402.00	100.00%	74,230,000.00	100.00%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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旗下部分基金增加江海证券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	2025-01-04
2	富安达基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	规定媒介	2025-01-21
3	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2024年第4季度报告	规定媒介	2025-01-21

4	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期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	2025-01-21
5	富安达基金管理有限公司关于富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金增加江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2025-03-08
6	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	2025-03-14
7	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加民商基金销售（上海）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	2025-03-15
8	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华创证券有限责任公司为销售机构的公告	规定媒介	2025-03-25
9	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	2025-03-28
10	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2024年年度报告	规定媒介	2025-03-28
11	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（2024年度）	规定媒介	2025-03-31
12	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加甬兴证券有限公司为销售机构的公	规定媒介	2025-04-11

	告		
13	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	2025-04-21
14	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2025年第1季度报告	规定媒介	2025-04-21
15	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期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	2025-04-26
16	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书更新提示性公告	规定媒介	2025-05-23
17	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二五年第一号）	规定媒介	2025-05-23
18	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2025-05-23
19	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金端午节前暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告	规定媒介	2025-05-28
20	富安达基金管理有限公司关于旗下基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	规定媒介	2025-05-30
21	富安达基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售	规定媒介	2025-06-06

	业务的公告		
22	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	2025-06-19
23	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加玄元保险代理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	2025-06-24
24	富安达基金管理有限公司关于富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金增加上海国信嘉利基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2025-06-26
25	富安达基金管理有限公司关于富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金增加上海攀赢基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2025-07-01
26	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	2025-07-19
27	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2025年第2季度报告	规定媒介	2025-07-19
28	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加博时财富基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2025-07-21
29	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申港证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2025-07-25

30	富安达基金管理有限公司关于富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金增加上海证达通基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2025-08-16
31	富安达基金管理有限公司旗下全部基金中期报告提示性公告	规定媒介	2025-08-29
32	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2025年中期报告	规定媒介	2025-08-29
33	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加华宝证券股份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	2025-08-30
34	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加北京加和基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2025-09-05
35	富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票“中芯国际”(688981)估值调整的公告	规定媒介	2025-09-05
36	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	2025-09-10
37	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2025-09-24
38	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金	规定媒介	2025-09-26

	国庆节前暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公告		
39	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳腾元基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2025-09-30
40	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	2025-10-25
41	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2025年第3季度报告	规定媒介	2025-10-25
42	富安达基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子假冒本公司名义进行诈骗活动的公告	规定媒介	2025-11-18
43	富安达基金管理有限公司关于终止直销网上交易平台、微信交易平台相关业务服务的公告	规定媒介	2025-11-29
44	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加奕丰基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2025-12-19
45	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	2025-12-25
46	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	2025-12-27
47	富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金元旦假期前暂停申购（转换转入、定期定额投资）的公	规定媒介	2025-12-27

	告		

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20250108-20251231	6,948,442.80	-	-	6,948,442.80	41.62%
	2	20250331-20250417	-	9,750,390.02	9,750,390.02	-	0.00%
	3	20251017-20251103	-	19,401,464.86	19,401,464.86	-	0.00%
	4	20251023-20251029	-	9,701,202.95	9,701,202.95	-	0.00%
个人	1	20250107-20250107	8,795,074.76	-	8,795,074.76	-	0.00%
	-	20250626-20250707	-	29,194,284.01	29,194,284.01	-	0.00%
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金注册的文件：

《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》；

《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》；

《富安达中证同业存单AAA指数7天持有期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。

13.2 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。

13.3 查阅方式

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

富安达基金管理有限公司

二〇二六年三月二十八日