富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金

2024 年年度报告

2024 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:2025 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2025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2024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 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
5.3 托管人对本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 16
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 21
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 54
8.1 期末基金资产组合情况 54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 54
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 55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 64
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 64
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 64
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 64
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 64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 64

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 64
8.12 投资组合报告附注 64
§9 基金份额持有人信息 65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 66
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 66
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 67
§10 开放式基金份额变动 68
§11 重大事件揭示 68
11.1 基金份额持有人大会决议 68
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 68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 68
11.4 基金投资策略的改变 68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 69
11.8 其他重大事件 73
§12 影响投资者决策的其他重要信息 77
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 77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 77
§13 备查文件目录 78
13.1 备查文件目录 78
13.2 存放地点 78
13.3 查阅方式 78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金	
基金简称	富安达智优量化选股混合型发起式	
基金主代码	018347	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年05月16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	10,237,518.30份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达智优量化选股混合型发起式A	富安达智优量化选股混合型发起式C
下属分级基金的交易代码	018347	018404
报告期末下属分级基金的份额总额	10,206,388.16份	31,130.14份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、衍生工具、现金等资产之间的配置比例。同时结合富安达择时量化模型，辅助判断大类资产配置及权益类资产仓位。 本基金将通过量化投资模型构建股票投资组合，包括但不限于量化多因子选股模型、量化行业配置模型及量化风险控制模型等，力图通过理性客观的投资及交易机制，在优选基本面质地较为优良且预期收益

	率较高个股的同时，控制组合整体的相对风险，从而形成优化后组合。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李理想	方圆
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道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	中国证券报
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）	北京市东城区东长安街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	2024年		2023年05月16日（基金合同生效日）-2023年12月31日	
	富安达智优量化选股混合型发起式A	富安达智优量化选股混合型发起式C	富安达智优量化选股混合型发起式A	富安达智优量化选股混合型发起式C
本期已实现收益	893,359.02	2,489.25	-542,097.48	-8,433.52
本期利润	1,157,954.36	2,505.15	-740,817.84	-11,389.46
加权平均基金份额本期利润	0.1152	0.0659	-0.0738	-0.0870
本期加权平均净值利润率	12.29%	7.11%	-7.62%	-8.85%
本期基金份额净值增长率	12.47%	11.98%	-7.38%	-7.59%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末	
期末可供分配利润	357,175.41	877.15	-742,698.15	-2,160.85
期末可供分配基金份额利润	0.0350	0.0282	-0.0738	-0.0759
期末基金资产净值	10,631,813.81	32,214.10	9,324,825.84	26,301.92
期末基金份额净值	1.0417	1.0348	0.9262	0.9241
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末	
基金份额累计净值增长率	4.17%	3.48%	-7.38%	-7.59%

注：

1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益

水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富安达智优量化选股混合型发起式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
过去三个月	4.17%	1.52%	-0.51%	1.42%	4.68%	0.10%
过去六个月	13.98%	1.39%	12.51%	1.37%	1.47%	0.02%
过去一年	12.47%	1.23%	11.87%	1.13%	0.60%	0.10%
自基金合同生效起至今	4.17%	1.03%	0.18%	0.97%	3.99%	0.06%

富安达智优量化选股混合型发起式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
过去三个月	4.06%	1.52%	-0.51%	1.42%	4.57%	0.10%
过去六个月	13.75%	1.39%	12.51%	1.37%	1.24%	0.02%
过去一年	11.98%	1.23%	11.87%	1.13%	0.11%	0.10%
自基金合同生效起至今	3.48%	1.03%	0.18%	0.97%	3.30%	0.06%

注：

1．中证800指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%

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 =80%×[中证800指数收益率t÷中证800指数收益率(t-1)-1]+20％×[中债总指数收益

率t÷中债总指数收益率(t-1)-1]

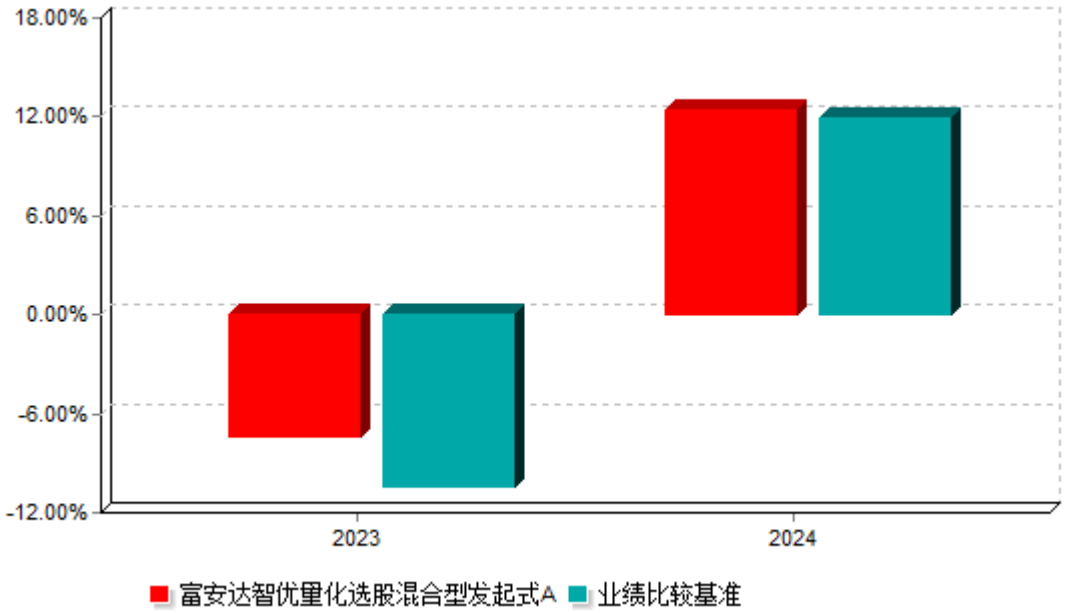
Benchmark t =(1+ Return t)×Benchmark(t-1)

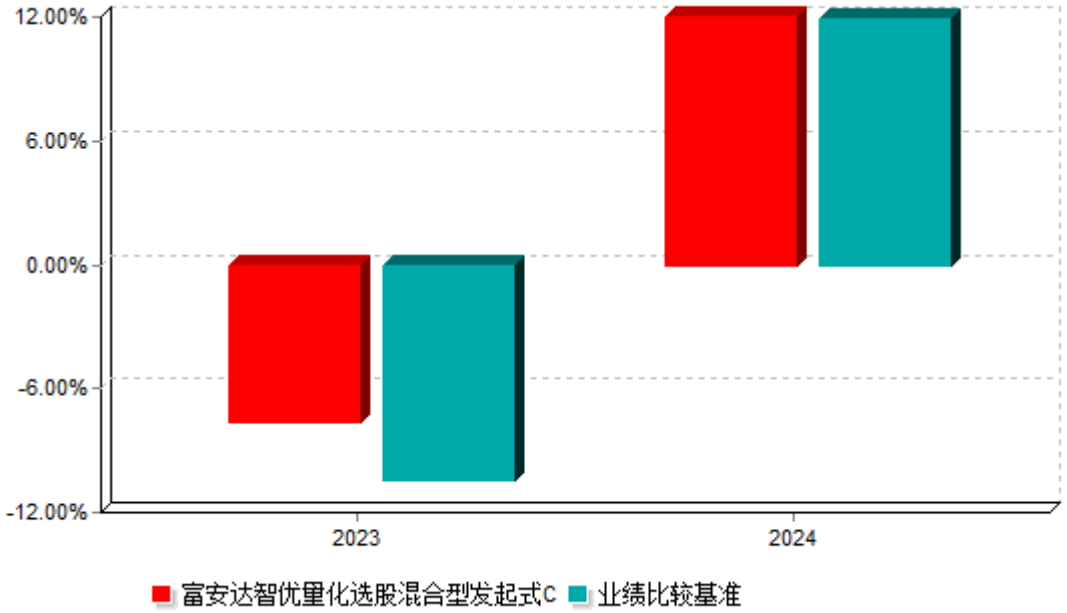
其中，t =1，2，3，...T，T 表示时间截至日。

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

注：本基金《基金合同》生效日为2023年5月16日。

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5月16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5月16日，自基金合同生效日至本报告期末无利润分配事项。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2024年12月31日，公司共管理二十八只开放式基金：富安达优势成长混合型证券投资基金、富安达策略精选灵活配置混合型证券投资基金、富安达增强收益债券型证券投资基金、富安达现金通货币市场证券投资基金、富安达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金、富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达新动力灵活配置混合型证券投资基金、富安达消费主题灵活配置混合型证券投资基金、富安达行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、富安达富利纯债债券型证券投资基金、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达科技领航混合型证券投资基金、富安达科技创新混合型发起式证券投资基金、富安达长三角区域主题混合型发起式证券投资基金、富安达医药创新混合型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达成长价值一年持有期混合型证券投资基金、富安达稳健配置6个月持有期混合型证券投资基金、富安达先进制造混合型发起式证券投资基金、富安达产业优选混合型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、富安达中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、富安达富祥利率债债券型证券投资基金、富安达富禧纯债30天持有期债券型证券投资基金、富安达睿选增利债券型证券投资基金、富安达上海清算所0-3年政策性金融债指数证券投资基金、富安达沪深300指数增强型证券投资基金。

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		
纪青	本基金的基金经理、	2023-05-16	-	16年	硕士。历任中海基金投研中

	指数与量化投资部副经理（主持工作）				心金融工程分析师。2013年加入富安达基金管理有限公司。现任指数与量化投资部副经理（主持工作）、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达沪深300指数增强型证券投资基金的基金经理。曾任富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022年7月至2022年11月兼任投资经理。

注：

①任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，任职日期为基金合同生效日。

②证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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、《富安达智优量化选股混合型发起式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

2024年，A股市场在国内外经济环境复杂多变的背景下，经历了显著的波动。年初，由于雪球产品集中触发敲入条件，市场迅速下跌，随后市场整体风险偏好偏谨慎。然而，9月下旬，中央政治局会议的召开带来了超出预期的积极信号，一系列旨在增强资本市场信心、改善市场环境并刺激经济的政策措施，如同组合拳一般，迅速激发了A股市场的投资热情，市场交易活跃度显著提升，甚至达到了历史性的高成交量。随着市场风格的快速转换，量化策略产品在获取相对市场平均水平的超额收益方面面临了更大的挑战，市场波动性也进一步加剧，不同风格的投资策略在波动的市场中表现出了明显的差异。在此背景下，本基金立足量化模型基础，严格遵循风险控制框架，规避了小市值因子的大幅波动和回撤对产品净值的影响，同时抓住了持续贡献收益的量化选股因子，全年实现了较好的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达智优量化选股混合型发起式A基金份额净值为1.0417元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.47%，同期业绩比较基准收益率为11.87%；截至报告期末富安达智优量化选股混合型发起式C基金份额净值为1.0348元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.98%，同期业绩比较基准收益率为11.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自2024年9月底以来，政策方向已经非常明确。尽管国内经济保持了稳定增长，但内生动能的恢复相对缓慢。在这一宏观背景下，资本市场的交易活跃度显著提升。一方面，管理层不断释放积极信号，强调将加强宏观政策的逆周期调节，实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，以支持民营企业和中小企业的发展，推动经济稳定增长；另一方面，DEEPSEEK概念的崛起极大地提振了市场情绪和信心，尤其是对科技股和AI相关板块的影响持续扩大。展望2025年，我们必须紧密关注货币政策和财政政策的调整动向，尤其是在消费、投资和出口等关键领域的政策信号。这些政策的变化将直接影响经济预期，进而决定A股市场底部的稳固程度。毫无疑问，中国科技将成为未来中长期的核心主线，政策支持与市场需求的双重推动将为相关行业带来持续的投资机遇。AI产业正逐步从事件驱动的主题投资转向业绩驱动的基本面投资，个股表现的分化趋势日益明显。未来，自下而上的选股策略需要更加聚焦于业绩支撑和基本面兑现的差异，以捕捉更具潜力的投资机会。

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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在富安达智优量化混合型发起式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智优量化混合型发起式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智优量化混合型发起式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2500434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	富安达智优量化选股混合型发起式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智优量化选股混合型发起式证券投资基金 (以下简称"该基金") 财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表、2024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2024年12月31日的财务状况以及2024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，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2024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	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2025-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	1,307,647.37	1,467,282.14
结算备付金		45,868.75	44,647.29
存出保证金		1,655.50	3,640.98
交易性金融资产	7.4.7.2	9,347,485.80	7,907,335.00
其中：股票投资		9,347,485.80	7,907,335.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		0.40	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		10,702,657.82	9,422,905.41
负债和净资产	**附注号**	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,754.87	9,471.59
应付托管费		1,792.46	1,578.58
应付销售服务费		11.01	8.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	26,071.57	60,718.58
负债合计		38,629.91	71,777.65
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	10,237,518.30	10,095,986.76
未分配利润	7.4.7.8	426,509.61	-744,859.00
净资产合计		10,664,027.91	9,351,127.76
负债和净资产总计		10,702,657.82	9,422,905.41

注： 报告截止日2024年12月31日，富安达智优量化选股混合型发起式A份额净值1.0417元，基金份额总额10,206,388.16份，富安达智优量化选股混合型发起式C份额净值1.0348元，基金份额总额31,130.14份，总份额合计10,237,518.30份。

7.2 利润表

会计主体：富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
一、营业总收入		1,302,371.61	-537,639.72
1.利息收入		3,099.75	5,557.05
其中：存款利息收入	7.4.7.9	3,099.75	3,699.24
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		-	1,857.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,034,039.15	-341,528.72
其中：股票投资收益	7.4.7.10	873,426.56	-457,688.77
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-	-
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	160,612.59	116,160.05
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	264,611.24	-201,676.30
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	621.47	8.25
减：二、营业总支出		141,912.10	214,567.58
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	113,336.96	74,194.20
2.托管费	7.4.10.2.2	18,889.46	12,365.67
3.销售服务费	7.4.10.2.3	140.68	327.71
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	7.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.20	9,545.00	127,680.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,160,459.51	-752,207.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,160,459.51	-752,207.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,160,459.51	-752,207.30

7.3 净资产变动表

会计主体：富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 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	10,095,986.76	-744,859.00	9,351,127.76
二、本期期初净资产	10,095,986.76	-744,859.00	9,351,127.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	141,531.54	1,171,368.61	1,312,900.15
（一）、综合收益总额	-	1,160,459.51	1,160,459.51
（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）	141,531.54	10,909.10	152,440.64
其中：1.基金申购款	302,604.90	-2,857.60	299,747.30
2.基金赎回款	-161,073.36	13,766.70	-147,306.66
（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	10,237,518.30	426,509.61	10,664,027.91
项 目	**上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023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	-	-	-
二、本期期初净资产	10,219,544.65	-	10,219,544.65
三、本期增减变动	-123,557.89	-744,859.00	-868,416.89

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-752,207.30	-752,207.30
（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）	-123,557.89	7,348.30	-116,209.59
其中：1.基金申购款	55,369.19	-2,603.89	52,765.30
2.基金赎回款	-178,927.08	9,952.19	-168,974.89
（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	10,095,986.76	-744,859.00	9,351,127.76

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

富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金（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]664号《关于准予富安达智优量化选股混合型发起式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《富安达智优量化选股混合型发起式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10,219,341.67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0289号验资报告予以验证。经向中国证监

会备案，《富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》于2023年5月16日生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,219,544.65份基金份额，其中认购资金利息折合202.98份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》和《富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购费/申购费的，称为A类基金份额；不收取认购费/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,009,200.20基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

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《富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权等）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）。本基金可以根据法律法规参与融资。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：股票资产投资比例为基金资产的60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权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。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%。

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2024年12月31日的财务状况、2024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

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

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

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

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且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，托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员

会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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 [2012] 85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小

企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、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) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	1,307,647.37	1,467,282.14
等于：本金	1,307,614.78	1,467,201.18
加：应计利息	32.59	80.96
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	1,307,647.37	1,467,282.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		9,284,550.86	-	9,347,485.80	62,934.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		9,284,550.86	-	9,347,485.80	62,934.94
项目		上年度末			

		2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,109,011.30	-	7,907,335.00	-201,676.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,109,011.30	-	7,907,335.00	-201,676.30

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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

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 2024年12月31日	上年度末 2023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	17,071.57	33,718.58
其中：交易所市场	17,071.57	33,718.58
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
应付审计费用	9,000.00	27,000.00
其他	-	-
合计	26,071.57	60,718.58

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 富安达智优量化选股混合型发起式A

金额单位：人民币元

项目 (富安达智优量化选股混合型发起式A)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,067,523.99	10,067,523.99
本期申购	163,571.12	163,571.12
本期赎回（以“-”号填列）	-24,706.95	-24,706.95
本期末	10,206,388.16	10,206,388.16

7.4.7.7.2 富安达智优量化选股混合型发起式C

金额单位：人民币元

项目 (富安达智优量化选股混合型发起式C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,462.77	28,462.77
本期申购	139,033.78	139,033.78
本期赎回（以“-”号填列）	-136,366.41	-136,366.41
本期末	31,130.14	31,130.14

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

7.4.7.8.1 富安达智优量化选股混合型发起式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

(富安达智优量化选股混合型发起式A)			
上年度末	-543,103.78	-199,594.37	-742,698.15
本期期初	-543,103.78	-199,594.37	-742,698.15
本期利润	893,359.02	264,595.34	1,157,954.36
本期基金份额交易产生的变动数	6,920.17	3,249.27	10,169.44
其中：基金申购款	4,515.52	2,525.23	7,040.75
基金赎回款	2,404.65	724.04	3,128.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	357,175.41	68,250.24	425,425.65

7.4.7.8.2 富安达智优量化选股混合型发起式C

单位：人民币元

项目 (富安达智优量化选股混合型发起式C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,596.99	-563.86	-2,160.85
本期期初	-1,596.99	-563.86	-2,160.85
本期利润	2,489.25	15.90	2,505.15
本期基金份额交易产生的变动数	-15.11	754.77	739.66
其中：基金申购款	-10,682.45	784.10	-9,898.35
基金赎回款	10,667.34	-29.33	10,638.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	877.15	206.81	1,083.96

7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日

活期存款利息收入	2,367.89	3,248.74
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	693.22	423.52
其他	38.64	26.98
合计	3,099.75	3,699.24

注：其他为存出保证金利息收入和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

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	67,995,728.82	37,957,483.27
减：卖出股票成本总额	66,994,585.68	38,303,799.95
减：交易费用	127,716.58	111,372.09
买卖股票差价收入	873,426.56	-457,688.77

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

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

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	160,612.59	116,160.05
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	160,612.59	116,160.05

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	264,611.24	-201,676.30
——股票投资	264,611.24	-201,676.30
——债券投资	-	-
——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	264,611.24	-201,676.30

7.4.7.18 其他收入

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12月31日	2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	621.47	8.25
基金转出费收入	-	-
合计	621.47	8.25

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 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	9,000.00	27,000.00
信息披露费	-	100,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划手续费	545.00	280.00
其他	-	400.00
合计	9,545.00	127,680.00

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
南京证券	32,138,524.77	23.60%	84,370,294.52	100.00%

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

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

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 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023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	-	-	1,870,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	23,000.26	27.06%	3,050.06	17.87%
关联方名称	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	79,260.08	100.00%	33,718.58	100.00%

注：1、上述佣金按协议约定的佣金计算，佣金率参考市场价格经协议签订方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括本基金管理人从南京证券获得证券研究综合服务；

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	113,336.96	74,194.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,639.91	532.86
应支付基金管理人的净管理费	111,697.05	73,661.34

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1.20%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×1.20%/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 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	18,889.46	12,365.67

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

名称	富安达智优量化选股混合型发起式A	富安达智优量化选股混合型发起式C	合计
富安达基金	0.00	42.65	42.65
合计	0.00	42.65	42.65

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达智优量化选股混合型发起式A	富安达智优量化选股混合型发起式C	合计
富安达基金	0.00	7.26	7.26
合计	0.00	7.26	7.26

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/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

富安达智优量化选股混合型发起式A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金合同生效日（2023年05月16日）持有的基金份额	10,009,200.20	10,009,200.20
报告期初持有的基金份额	10,009,200.20	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,009,200.20	10,009,200.20
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	98.07%	99.42%

注：1、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富安达智优量化混合C的情况。

2、基金管理人投资本基金适用的费率按照招募说明书的规定执行。

3、持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年05月16日（基金合同生效日）至2023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	1,307,647.37	2,367.89	1,467,282.14	3,248.74

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2024年12月31日的相关余额为人民币45,868.75元。（2023年12月31日：人民币44,647.29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。（2023年：无）

7.4.12 期末（2024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2024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2024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2024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

于2024年12月31日，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2024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

本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过量化投资精选股票，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

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。

于2024年12月31日，本基金无债券投资(2023年12月31日：同)。

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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于2024年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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(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15%。于2024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2024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、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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	1,307,647.37	-	-	-	1,307,647.37
结算备付金	45,868.75	-	-	-	45,868.75
存出保	1,655.50	-	-	-	1,655.50

证金					
交易性金融资产	-	-	-	9,347,485.80	9,347,485.80
应收申购款	-	-	-	0.40	0.40
资产总计	1,355,171.62	-	-	9,347,486.20	10,702,657.82
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,754.87	10,754.87
应付托管费	-	-	-	1,792.46	1,792.46
应付销售服务费	-	-	-	11.01	11.01
其他负债	-	-	-	26,071.57	26,071.57
负债总计	-	-	-	38,629.91	38,629.91
利率敏感度缺口	1,355,171.62	-	-	9,308,856.29	10,664,027.91
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	1,467,282.14	-	-	-	1,467,282.14
结算备付金	44,647.29	-	-	-	44,647.29
存出保证金	3,640.98	-	-	-	3,640.98
交易性	-	-	-	7,907,335.00	7,907,335.00

金融资产					
资产总计	1,515,570.41	-	-	7,907,335.00	9,422,905.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,471.59	9,471.59
应付托管费	-	-	-	1,578.58	1,578.58
应付销售服务费	-	-	-	8.90	8.90
其他负债	-	-	-	60,718.58	60,718.58
负债总计	-	-	-	71,777.65	71,777.65
利率敏感度缺口	1,515,570.41	-	-	7,835,557.35	9,351,127.76

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

于2024年12月31日，本基金未持有交易性金融资产-债券投资(2023年12月31日：同)，因此，市场利率的变动对本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

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股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势做出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、衍生工具、现金等资产之间的配置比例。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	9,347,485.80	87.65	7,907,335.00	84.56
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
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	9,347,485.80	87.65	7,907,335.00	84.56

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证800指数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12月31日	上年度末 2023年12月31日
	1.中证800指数上升5%	444,426.21	350,097.26
	2.中证800指数下降5%	-444,426.21	-350,097.26

注：本基金本期末其他价格风险的敏感性计算中所使用的β系数为股票组合的β系数，即资产负债表日投资组合内各个股票的β加权平均。

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	9,347,485.80	7,815,265.00
第二层次	-	92,070.00
第三层次	-	-
合计	9,347,485.80	7,907,335.00

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2024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(2023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2024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	9,347,485.80	87.34
	其中：股票	9,347,485.80	87.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,353,516.12	12.65
8	其他各项资产	1,655.90	0.02
9	合计	10,702,657.82	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	198,072.00	1.86
C	制造业	7,022,261.80	65.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,008.00	0.85
E	建筑业	358,807.00	3.36
F	批发和零售业	242,970.00	2.28
G	交通运输、仓储和邮政业	376,515.00	3.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,996.00	0.46
J	金融业	461,462.00	4.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	372,311.00	3.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	87,958.00	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	87,125.00	0.82
S	综合	-	-
	合计	9,347,485.80	87.65

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

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

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	300750	宁德时代	1,900	505,400.00	4.74

2	002475	立讯精密	12,100	493,196.00	4.62
3	002594	比亚迪	1,200	339,192.00	3.18
4	002371	北方华创	700	273,700.00	2.57
5	000651	格力电器	5,800	263,610.00	2.47
6	600309	万华化学	2,900	206,915.00	1.94
7	000425	徐工机械	25,400	201,422.00	1.89
8	601899	紫金矿业	13,100	198,072.00	1.86
9	000333	美的集团	2,600	195,572.00	1.83
10	600693	东百集团	23,700	165,900.00	1.56
11	000063	中兴通讯	4,100	165,640.00	1.55
12	002648	卫星化学	8,700	163,473.00	1.53
13	600030	中信证券	5,400	157,518.00	1.48
14	600519	贵州茅台	100	152,400.00	1.43
15	002311	海大集团	2,900	142,245.00	1.33
16	688012	中微公司	700	132,412.00	1.24
17	300866	安克创新	1,200	117,168.00	1.10
18	601658	邮储银行	19,700	111,896.00	1.05
19	600177	雅戈尔	12,300	109,470.00	1.03
20	000938	紫光股份	3,900	108,537.00	1.02
21	600765	中航重机	5,300	108,491.00	1.02
22	600660	福耀玻璃	1,700	106,080.00	0.99
23	600967	内蒙一机	12,300	104,550.00	0.98
24	600103	青山纸业	40,800	104,448.00	0.98
25	600269	赣粤高速	18,500	103,785.00	0.97
26	600391	航发科技	5,200	103,220.00	0.97
27	601877	正泰电器	4,400	103,004.00	0.97
28	600887	伊利股份	3,400	102,612.00	0.96
29	000157	中联重科	14,000	101,220.00	0.95
30	002249	大洋电机	17,100	100,377.00	0.94
31	601100	恒立液压	1,900	100,263.00	0.94
32	600019	宝钢股份	14,300	100,100.00	0.94

33	002860	星帅尔	10,200	100,062.00	0.94
34	601717	郑煤机	7,700	99,946.00	0.94
35	000725	京东方A	22,700	99,653.00	0.93
36	605499	东鹏饮料	400	99,408.00	0.93
37	603040	新坐标	4,300	98,556.00	0.92
38	002027	分众传媒	14,000	98,420.00	0.92
39	000858	五粮液	700	98,028.00	0.92
40	601117	中国化学	11,800	97,822.00	0.92
41	601997	贵阳银行	16,200	97,200.00	0.91
42	601989	中国重工	20,200	97,162.00	0.91
43	600426	华鲁恒升	4,400	95,084.00	0.89
44	601868	中国能建	41,500	95,035.00	0.89
45	600755	厦门国贸	14,300	94,952.00	0.89
46	301379	天山电子	4,700	94,940.00	0.89
47	002958	青农商行	31,200	94,848.00	0.89
48	600017	日照港	29,500	94,400.00	0.89
49	600284	浦东建设	15,000	94,050.00	0.88
50	601888	中国中免	1,400	93,814.00	0.88
51	000792	盐湖股份	5,600	92,176.00	0.86
52	002304	洋河股份	1,100	91,883.00	0.86
53	002228	合兴包装	30,500	91,500.00	0.86
54	000060	中金岭南	19,500	91,455.00	0.86
55	002206	海利得	21,300	91,377.00	0.86
56	601008	连云港	23,800	91,154.00	0.85
57	002479	富春环保	19,200	91,008.00	0.85
58	000528	柳工	7,500	90,450.00	0.85
59	600784	鲁银投资	15,300	90,117.00	0.85
60	603987	康德莱	12,500	89,750.00	0.84
61	603321	梅轮电梯	12,700	88,900.00	0.83
62	603926	铁流股份	10,000	88,500.00	0.83
63	002573	清新环境	22,100	87,958.00	0.82

64	601872	招商轮船	13,600	87,176.00	0.82
65	600229	城市传媒	12,500	87,125.00	0.82
66	600493	凤竹纺织	16,600	85,822.00	0.80
67	600436	片仔癀	400	85,800.00	0.80
68	600790	轻纺城	22,700	85,125.00	0.80
69	600448	华纺股份	32,000	84,800.00	0.80
70	002696	百洋股份	17,000	80,410.00	0.75
71	000632	三木集团	21,000	77,070.00	0.72
72	600820	隧道股份	10,000	71,900.00	0.67
73	300308	中际旭创	580	71,635.80	0.67
74	600487	亨通光电	3,800	65,436.00	0.61
75	600585	海螺水泥	2,300	54,694.00	0.51
76	002517	恺英网络	3,600	48,996.00	0.46

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

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	002475	立讯精密	940,911.00	10.06
2	300750	宁德时代	780,132.00	8.34
3	000333	美的集团	735,932.00	7.87
4	000425	徐工机械	590,262.00	6.31
5	002415	海康威视	551,419.66	5.90
6	000651	格力电器	548,954.00	5.87
7	601899	紫金矿业	543,129.00	5.81
8	300308	中际旭创	497,283.00	5.32
9	002463	沪电股份	476,899.00	5.10
10	002594	比亚迪	467,870.00	5.00
11	002027	分众传媒	465,668.00	4.98

12	600309	万华化学	456,474.00	4.88
13	600150	中国船舶	456,294.00	4.88
14	600585	海螺水泥	454,612.00	4.86
15	002371	北方华创	407,991.00	4.36
16	600900	长江电力	404,538.00	4.33
17	600031	三一重工	392,970.00	4.20
18	600426	华鲁恒升	379,216.00	4.06
19	002228	合兴包装	364,404.00	3.90
20	600183	生益科技	358,397.00	3.83
21	600332	白云山	358,094.00	3.83
22	600036	招商银行	355,770.00	3.80
23	000823	超声电子	352,993.00	3.77
24	000157	中联重科	349,453.00	3.74
25	601668	中国建筑	346,381.00	3.70
26	600582	天地科技	344,054.00	3.68
27	600519	贵州茅台	335,489.00	3.59
28	600276	恒瑞医药	317,802.00	3.40
29	000063	中兴通讯	317,008.00	3.39
30	300979	华利集团	311,337.00	3.33
31	601989	中国重工	309,421.00	3.31
32	600989	宝丰能源	291,121.00	3.11
33	601186	中国铁建	274,743.00	2.94
34	688169	石头科技	273,231.82	2.92
35	000800	一汽解放	272,616.00	2.92
36	002449	国星光电	272,265.00	2.91
37	600391	航发科技	269,440.00	2.88
38	601390	中国中铁	268,352.00	2.87
39	601985	中国核电	267,680.00	2.86
40	600871	石化油服	267,516.00	2.86
41	600873	梅花生物	266,860.00	2.85
42	600690	海尔智家	266,438.00	2.85

43	601006	大秦铁路	265,282.00	2.84
44	002448	中原内配	264,072.00	2.82
45	002004	华邦健康	263,598.00	2.82
46	002376	新北洋	263,462.00	2.82
47	601618	中国中冶	261,738.00	2.80
48	600941	中国移动	260,293.00	2.78
49	601138	工业富联	256,786.00	2.75
50	600637	东方明珠	255,788.00	2.74
51	600887	伊利股份	251,440.00	2.69
52	002493	荣盛石化	249,746.00	2.67
53	002311	海大集团	234,343.00	2.51
54	601857	中国石油	228,040.00	2.44
55	300760	迈瑞医疗	224,533.00	2.40
56	601088	中国神华	210,385.00	2.25
57	000792	盐湖股份	208,620.00	2.23
58	600104	上汽集团	204,439.00	2.19
59	000858	五 粮 液	203,581.00	2.18
60	600487	亨通光电	203,406.00	2.18
61	601872	招商轮船	202,564.00	2.17
62	002601	龙佰集团	200,021.00	2.14
63	601717	郑煤机	196,032.00	2.10
64	601600	中国铝业	192,378.00	2.06
65	603321	梅轮电梯	192,024.00	2.05
66	600019	宝钢股份	190,543.00	2.04
67	600037	歌华有线	190,412.00	2.04
68	601997	贵阳银行	190,236.00	2.03
69	601607	上海医药	190,214.00	2.03
70	600269	赣粤高速	190,194.00	2.03
71	601868	中国能建	189,927.00	2.03
72	600845	宝信软件	189,368.00	2.03
73	600448	华纺股份	189,230.00	2.02

74	600693	东百集团	189,127.00	2.02
75	002206	海 利 得	188,871.00	2.02
76	600660	福耀玻璃	188,869.00	2.02
77	002479	富春环保	188,409.00	2.01
78	600436	片仔癀	188,288.00	2.01
79	000156	华数传媒	187,487.00	2.00
80	603727	博迈科	187,343.00	2.00

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。

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

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	002415	海康威视	770,905.00	8.24
2	000333	美的集团	762,942.00	8.16
3	002475	立讯精密	659,095.00	7.05
4	600031	三一重工	618,388.00	6.61
5	002463	沪电股份	566,219.00	6.06
6	300750	宁德时代	564,461.00	6.04
7	601985	中国核电	538,148.00	5.75
8	600276	恒瑞医药	530,562.00	5.67
9	002027	分众传媒	523,319.00	5.60
10	300308	中际旭创	512,016.00	5.48
11	600519	贵州茅台	503,875.00	5.39
12	600900	长江电力	498,064.00	5.33
13	601668	中国建筑	468,289.60	5.01
14	000651	格力电器	457,979.00	4.90
15	600582	天地科技	451,187.00	4.82
16	000425	徐工机械	424,134.00	4.54
17	600150	中国船舶	412,607.00	4.41

18	600585	海螺水泥	388,023.00	4.15
19	600183	生益科技	380,658.00	4.07
20	000157	中联重科	367,491.00	3.93
21	600036	招商银行	355,067.00	3.80
22	600332	白云山	354,011.00	3.79
23	601727	上海电气	338,446.00	3.62
24	601857	中国石油	332,516.00	3.56
25	601899	紫金矿业	331,976.00	3.55
26	000823	超声电子	331,811.00	3.55
27	600104	上汽集团	327,230.00	3.50
28	300760	迈瑞医疗	315,196.00	3.37
29	601138	工业富联	315,086.00	3.37
30	601607	上海医药	314,438.00	3.36
31	600309	万华化学	307,147.00	3.28
32	600426	华鲁恒升	307,108.00	3.28
33	601766	中国中车	299,937.00	3.21
34	600989	宝丰能源	296,170.00	3.17
35	601186	中国铁建	294,528.00	3.15
36	603012	创力集团	292,420.00	3.13
37	000100	TCL科技	290,966.00	3.11
38	300979	华利集团	288,708.00	3.09
39	601390	中国中铁	287,972.00	3.08
40	600741	华域汽车	281,594.00	3.01
41	600690	海尔智家	278,350.00	2.98
42	002449	国星光电	277,108.00	2.96
43	601618	中国中冶	275,937.00	2.95
44	000800	一汽解放	274,369.00	2.93
45	600871	石化油服	274,314.00	2.93
46	600887	伊利股份	272,505.00	2.91
47	600048	保利发展	272,077.00	2.91
48	002228	合兴包装	271,144.00	2.90

49	688169	石头科技	268,159.40	2.87
50	600873	梅花生物	266,967.00	2.85
51	002004	华邦健康	266,672.00	2.85
52	600941	中国移动	261,590.00	2.80
53	600637	东方明珠	257,178.00	2.75
54	601006	大秦铁路	252,394.00	2.70
55	002493	荣盛石化	251,470.00	2.69
56	002448	中原内配	244,716.00	2.62
57	600050	中国联通	231,820.00	2.48
58	002376	新北洋	230,576.00	2.47
59	603366	日出东方	225,080.00	2.41
60	000063	中兴通讯	218,907.00	2.34
61	601088	中国神华	206,687.00	2.21
62	601600	中国铝业	204,464.00	2.19
63	002714	牧原股份	195,080.00	2.09
64	601225	陕西煤业	194,526.00	2.08
65	601989	中国重工	193,679.00	2.07
66	601608	中信重工	192,612.00	2.06
67	603993	洛阳钼业	192,248.00	2.06
68	688469	芯联集成	192,198.00	2.06
69	600517	国网英大	192,050.00	2.05
70	600025	华能水电	190,865.00	2.04
71	002601	龙佰集团	189,127.00	2.02
72	002662	京威股份	188,872.00	2.02
73	600219	南山铝业	188,618.00	2.02
74	601169	北京银行	188,189.00	2.01

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。

8.4.3 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	68,170,125.24

卖出股票收入（成交）总额	67,995,728.82

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	1,655.50
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	0.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,655.90

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
富安达智优量化选	35	291,611.09	10,009,200.20	98.07%	197,187.96	1.93%

股混合型发起式A						
富安达智优量化选股混合型发起式C	46	676.74	0.00	0.00%	31,130.14	100.00%
合计	81	126,389.11	10,009,200.20	97.77%	228,318.10	2.23%

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

9.2 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	富安达智优量化选股混合型发起式A	17,632.02	0.17%
	富安达智优量化选股混合型发起式C	22,762.89	73.12%
	合计	40,394.91	0.39%

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

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资	富安达智优量化选	0

和研究部门负责人持有本开放式基金	股混合型发起式A	
	富安达智优量化选股混合型发起式C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达智优量化选股混合型发起式A	0~10
	富安达智优量化选股混合型发起式C	0~10
	合计	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。

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。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,200.20	97.77%	10,009,200.20	97.77%	自合同生效之日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,009,200.20	97.77%	10,009,200.20	97.77%	自合同生效之日起不少于3年

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达智优量化选股混合型发起式A	富安达智优量化选股混合型发起式C
基金合同生效日(2023年05月16日)基金份额总额	10,027,280.85	192,263.80
本报告期期初基金份额总额	10,067,523.99	28,462.77
本报告期基金总申购份额	163,571.12	139,033.78
减：本报告期基金总赎回份额	24,706.95	136,366.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,206,388.16	31,130.14

§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，本基金管理人聘任王胜为董事长，聘任金领千为总经理；蒋晓刚不再担任董事长，王胜不再担任总经理，沈伟青不再担任副总经理。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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9,000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2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
德邦证券	1	6,832,214.45	5.02%	3,046.59	3.58%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	17,553,921.72	12.89%	13,093.77	15.41%	-
五矿证券	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	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

大同证券	2	6,898,641.00	5.07%	5,145.62	6.05%	-
东北证券	2	11,255,566.17	8.27%	5,019.13	5.91%	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	5,445,549.00	4.00%	4,061.90	4.78%	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	6,066,394.00	4.46%	2,705.04	3.18%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	13,819,074.08	10.15%	6,162.00	7.25%	-
国泰君安	2	4,611,269.00	3.39%	2,056.06	2.42%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	9,322,783.56	6.85%	4,156.89	4.89%	-
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	32,138,524.77	23.60%	23,000.26	27.06%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	5,601,426.40	4.11%	4,178.11	4.92%	-
天风证券	2	116,230.00	0.09%	51.82	0.06%	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-
中邮	2	-	-	-	-	-

证券						
上海证券	3	16,504,259.91	12.12%	12,310.09	14.48%	-
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，(017888)麦高证券、(59075、017923)招商证券、(59740)德邦证券、 (59593、396732)华源证券、(23217)华泰证券、(018325)国泰君安、 (60021、018452)中邮证券、(20181)湘财证券、(51424)华创证券、(55851)甬兴证券为本基金本期新增的交易单元。本基金本期剔除交易单元：(391893)东方证券、(39632)中信建投、(001461)国信证券、(53614)东亚前海证券、(52636)中银国际证券、(016338)五矿证券、(39181)方正证券。

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（2024年度）的报告期为2024年7月1日至2024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

本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

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旗	规定媒介	2024-01-19

	下全部基金季度报告提示性公告		
2	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金2023年第4季度报告	规定媒介	2024-01-19
3	富安达基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定媒介	2024-01-30
4	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加乾道基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-02-06
5	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2024-03-05
6	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加众惠基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-03-13
7	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-03-28
8	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2024-03-29
9	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金2023年年度报告	规定媒介	2024-03-29
10	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	2024-04-18
11	富安达智优量化选股混合型	规定媒介	2024-04-18

	发起式证券投资基金2024年第1季度报告		
12	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书更新提示性公告	规定媒介	2024-04-24
13	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二四年第一号）	规定媒介	2024-04-24
14	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2024-04-24
15	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-05-09
16	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-05-30
17	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-06-13
18	富安达基金管理有限公司关于旗下部分基金增加湘财证券股份有限公司为销售机构的公告	规定媒介	2024-06-26
19	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2024-06-26
20	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-06-27
21	富安达基金管理有限公司关于变更直销柜台汇款交易业务银行账户的公告	规定媒介	2024-06-28

22	富安达基金管理有限公司关于终止直销网上交易平台、微信交易平台开户、认购、申购（含定期定额投资）、基金转换业务的公告	规定媒介	2024-07-06
23	富安达基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定媒介	2024-07-11
24	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	2024-07-18
25	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金2024年第2季度报告	规定媒介	2024-07-18
26	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	2024-08-29
27	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金2024年中期报告	规定媒介	2024-08-29
28	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-09-26
29	富安达基金管理有限公司关于旗下基金所持股票“国泰君安”(601211) 估值调整的公告	规定媒介	2024-10-09
30	富安达基金管理有限公司董事长变更公告	规定媒介	2024-10-15
31	富安达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定媒介	2024-10-15
32	富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金2024年	规定媒介	2024-10-24

	第3季度报告		
33	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	2024-10-24
34	富安达基金管理有限公司关于旗下基金参加中信银行股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2024-11-06
35	富安达基金管理有限公司关于变更直销柜台汇款交易业务银行账户的公告	规定媒介	2024-11-12
36	富安达基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定媒介	2024-11-27
37	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2024-12-20

§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	20240101-20241231	10,009,200.20	0.00	0.00	10,009,200.20	97.77%
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、中国证监会批准富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金设立的文件：

《富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书》；

《富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》；

《富安达智优量化选股混合型发起式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

二〇二五年三月二十八日