

# 富荣沪深 300 指数增强型证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2021 年 01 月 22 日

## 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示.....                                  | 3  |
| §2 基金产品概况.....                                | 3  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现.....                         | 4  |
| 3.1 主要财务指标.....                               | 4  |
| 3.2 基金净值表现.....                               | 4  |
| §4 管理人报告.....                                 | 6  |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....                      | 6  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....               | 7  |
| 4.3 公平交易专项说明.....                             | 7  |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....                     | 8  |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现.....                          | 8  |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....                | 8  |
| §5 投资组合报告.....                                | 8  |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况.....                         | 8  |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                     | 9  |
| 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细.....     | 11 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....                   | 11 |
| 5.5 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债券投资明细.....     | 11 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细..... | 11 |
| 5.7 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.....    | 12 |
| 5.8 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权证投资明细.....     | 12 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....                 | 12 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....                | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注.....                            | 12 |
| §6 开放式基金份额变动.....                             | 13 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....                    | 13 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....                     | 13 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....                 | 13 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息.....                        | 13 |
| 8.1 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.....        | 14 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                       | 14 |
| §9 备查文件目录.....                                | 14 |
| 9.1 备查文件目录.....                               | 14 |
| 9.2 存放地点.....                                 | 14 |
| 9.3 查阅方式.....                                 | 14 |

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年10月01日起至2020年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 富荣沪深300指数增强   |
| 基金主代码      | 004788  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2019年01月24日   |
| 报告期末基金份额总额 | 355,512,857.06份   |
| 投资目标       | 本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。                                |
| 投资策略       | 本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与沪深300指数偏离风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过8.0%。 |
| 业绩比较基准     | 沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%  |
| 风险收益特征     | 基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于证券投资基金中中高等风险、中高等预期收益的品种。本  |

|                 |   |                 |
|-----------------|---|-----------------|
|                 | 基金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |                 |
| 基金管理人           | 富荣基金管理有限公司  |                 |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 富荣沪深300指数增强A  | 富荣沪深300指数增强C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 004788  | 004789          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 79,009,757.56份  | 276,503,099.50份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2020年10月01日 - 2020年12月31日) |                  |
|-----------------|--------------------------------|------------------|
|                 | 富荣沪深300指数增强<br>A               | 富荣沪深300指数增强<br>C |
| 1. 本期已实现收益      | 5,320,303.46                   | 17,901,718.95    |
| 2. 本期利润         | 20,837,326.37                  | 72,662,117.64    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.3057                         | 0.3070           |
| 4. 期末基金资产净值     | 153,178,262.98                 | 534,335,190.35   |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.9387                         | 1.9325           |

注：①上述基金业绩指标不包括持有人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。

#### 3.2 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

富荣沪深300指数增强A净值表现

| 阶段    | 净值增长率① | 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 | 17.59% | 1.16%     | 12.90%     | 0.94%         | 4.69% | 0.22% |

|            |         |       |        |       |         |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去六个月      | 45.45%  | 1.40% | 23.83% | 1.28% | 21.62%  | 0.12% |
| 过去一年       | 85.59%  | 1.47% | 25.86% | 1.36% | 59.73%  | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 169.11% | 1.35% | 62.15% | 1.28% | 106.96% | 0.07% |

## 富荣沪深300指数增强C净值表现

| 阶段         | 净值增长率①  | 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      | 17.56%  | 1.16%     | 12.90%     | 0.94%         | 4.66%   | 0.22% |
| 过去六个月      | 45.38%  | 1.40%     | 23.83%     | 1.28%         | 21.55%  | 0.12% |
| 过去一年       | 85.41%  | 1.47%     | 25.86%     | 1.36%         | 59.55%  | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 168.55% | 1.35%     | 62.15%     | 1.28%         | 106.40% | 0.07% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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

富荣沪深300指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



富荣沪深300指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务           | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|--------------|-------------|------|--------|--|
|     |              | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 邓宇翔 | 权益投资部总监、基金经理 | 2018-11-06  | -    | 14     | 硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任西南证券股份有限公司资深投资经理、深圳东新佳投资有限公司投资经理。2017年2月22日加入富荣基金。 |
| 郎骋成 | 研究部总监、基金经理   | 2020-07-16  | -    | 14     | 硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任锦泰期货有限公司宏观和化工研究员、金东矿                               |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 业股份有限公司主持上市办公室工作、弘业期货股份有限公司投资咨询负责人及研究所所长、摩根士丹利华鑫基金另类投资小组副组长/专户投资经理/专户理财部副总监。2020年6月加入富荣基金。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：本基金已于2019年1月24日转型，转型后仍由邓宇翔担任基金经理。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值(元)        | 任职时间       |
|-----|----------|---------|----------------|------------|
| 郎聘成 | 公募基金     | 3       | 729,088,975.27 | 2020-07-16 |
|     | 私募资产管理计划 | 2       | 92,412,019.81  | 2020-09-22 |
|     | 其他组合     | -       | -              | -          |
|     | 合计       | 5       | 821,500,995.08 | -          |

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日、3日内、5日内），对旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析，报告期内未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金运用数量化方法对沪深300成分股进行组合优化，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。在具体策略上，本基金有别于传统多因子选股的量化策略，通过量化的方式分析公司和宏观，在此基础上通过自下而上（从公司的集合看行业）及自上而下（从宏观的角度看行业）的方法确定优势行业，再通过量化筛选结合主动调研的方式选取具有良好增长能力的股票构建股票组合。

报告期内，A股市场延续结构性分化行情，创业板领涨的同时科创50表现落后。其中，上证综指上涨7.92%，上证50指数上涨12.63%，沪深300指数上涨13.60%，中小板指上涨10.07%，创业板指上涨15.21%，科创50下跌1.81%。从申万一级行业指数看，有色金属、电气设备、食品饮料分别上涨30.31%、29.73%、25.73%，表现较好；商业贸易、传媒计算机分别下跌10.56%、9.61%、7.01%，表现相对较弱。

报告期内，本基金在持仓结构上基本保持稳定，根据上市公司三季报及行业间的估值比较，我们继续维持较高的食品饮料行业持有比例，但在其他行业（如新能源）对个股进行了一些调整。尽管市场风格变化较大，但本基金仍秉承在客观量化的基础上审慎选股的理念，力求保持组合长期的稳定性。报告期内，本基金仓位基本保持稳定。

展望一季度，在全球复苏的宏观背景下，汽车家电等可选消费以及化工油气等顺周期行业有望继续受益通胀预期升温和低基数带来的同比高增长红利。同时，估值已经在2020年四季度率先展开调整的科技板块，特别是其中成长性相对确定的重点公司，值得密切跟踪。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣沪深300指数增强A基金份额净值为1.9387元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为17.59%，同期业绩比较基准收益率为12.90%；截至报告期末富荣沪深300指数增强C基金份额净值为1.9325元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为17.56%，同期业绩比较基准收益率为12.90%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目    | 金额(元)          | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资  | 618,491,243.57 | 88.92            |
|    | 其中：股票 | 618,491,243.57 | 88.92            |



|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 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      | 72,234,304.23  | 10.39  |
| 8 | 其他资产              | 4,834,506.59   | 0.70   |
| 9 | 合计                | 695,560,054.39 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末（指数投资）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         | 366,996.00     | 0.05         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 312,314,179.34 | 45.43        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 33,737,238.72  | 4.91         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 39,780,514.80  | 5.79         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 459,081.00     | 0.07         |
| J  | 金融业              | 116,475,104.27 | 16.94        |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 53,094,867.00  | 7.72         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -            |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 21,321,183.00  | 3.10  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 577,549,164.13 | 84.01 |

### 5.2.2 报告期末（积极投资）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              | -             | -            |
| C  | 制造业              | 39,526,691.41 | 5.75         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 16,322.72     | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17,065.16     | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 440,003.25    | 0.06         |
| J  | 金融业              | 283,040.00    | 0.04         |
| K  | 房地产业             | 389,945.14    | 0.06         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 269,011.76    | 0.04         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| 0  | 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        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 40,942,079.44 | 5.96         |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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  | 600809 | 山西汾酒 | 165,400   | 62,072,966.00 | 9.03         |
| 2  | 600438 | 通威股份 | 1,350,600 | 51,917,064.00 | 7.55         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 173,200   | 50,548,420.00 | 7.35         |
| 4  | 300059 | 东方财富 | 1,570,000 | 48,670,000.00 | 7.08         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 24,200    | 48,351,600.00 | 7.03         |
| 6  | 603833 | 欧派家居 | 352,374   | 47,394,303.00 | 6.89         |
| 7  | 600009 | 上海机场 | 525,780   | 39,780,514.80 | 5.79         |
| 8  | 002142 | 宁波银行 | 1,030,093 | 36,403,486.62 | 5.29         |
| 9  | 002032 | 苏泊尔  | 465,592   | 36,311,520.08 | 5.28         |
| 10 | 600886 | 国投电力 | 3,904,773 | 33,737,238.72 | 4.91         |

#### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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  | 002242 | 九阳股份 | 968,000 | 31,014,720.00 | 4.51         |
| 2  | 600529 | 山东药玻 | 94,900  | 4,759,235.00  | 0.69         |
| 3  | 002223 | 鱼跃医疗 | 30,350  | 856,173.50    | 0.12         |
| 4  | 300146 | 汤臣倍健 | 19,800  | 478,170.00    | 0.07         |
| 5  | 002078 | 太阳纸业 | 28,900  | 417,027.00    | 0.06         |

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

##### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 83,571.60  |
| 2  | 应收证券清算款 | 743,616.40 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 6,714.85   |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 4,000,603.74 |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 其他    | -            |
| 8 | 合计    | 4,834,506.59 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限股票。

##### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限股票。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                               | 富荣沪深300指数增强A  | 富荣沪深300指数增强C   |
|-------------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 59,334,805.26 | 231,091,693.48 |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 47,200,323.35 | 139,054,081.85 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 27,525,371.05 | 93,642,675.83  |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -             | -              |
| 报告期期末基金份额总额                   | 79,009,757.56 | 276,503,099.50 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 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              | 20201001 - 20201208    | 61,470,371.28 | -    | -          | 61,470,371.28 | 17.29% |
| 产品特有风险   |                |                        |               |      |            |               |        |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> |                |                        |               |      |            |               |        |

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

高峰总经理于2020年11月9日任职，杨小舟先生不再代任总经理职务，将继续担任公司董事长。相关人事变动已按规定备案。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准富荣沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 9.1.2 《富荣沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 9.1.3 《富荣沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 9.1.5 报告期内富荣沪深300指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富荣基金管理有限公司，客服热线：4006855600。

富荣基金管理有限公司

2021年01月22日