

富荣医药健康混合型发起式证券投资基金

2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26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 | 6 |
| 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 | 7 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 | 7 |
| 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 | 8 |
| 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 | 9 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | 10 |
| 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 | 10 |
| 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 | 10 |
| 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 | 10 |
| 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 | 10 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 10 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 10 |
| 5.11 投资组合报告附注 | 11 |
| §6 开放式基金份额变动 | 11 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 | 12 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 12 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 12 |
| §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况 | 12 |
| §9 影响投资者决策的其他重要信息 | 13 |
| 9.1 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 | 13 |
| 9.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 13 |
| §10 备查文件目录 | 13 |
| 10.1 备查文件目录 | 13 |
| 10.2 存放地点 | 13 |
| 10.3 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月24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2022年7月1日起至2022年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 富荣医药健康混合发起 |
| 基金主代码 | 015655 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年06月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 15,857,767.93份 |
| 投资目标 | 本基金精选医药健康行业优质企业，在严格控制风险的前提下，力争基金资产长期稳健增值，为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金采用的投资策略有：大类资产配置、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资业务投资策略等。本基金所指的医药健康相关行业，是在中国经济科技不断发展、人口老龄化程度提高的背景下，可以满足人民日益增长的健康保健需要及美好生活需求的行业。 |
| 业绩比较基准 | 中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。 |

| | | |
|-----------------|----------------|---------------|
| 基金管理人 | 富荣基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富荣医药健康混合发起A | 富荣医药健康混合发起C |
| 下属分级基金的交易代码 | 015655 | 015656 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 14,694,894.60份 | 1,162,873.33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(2022年07月01日 - 2022年09月30日) | |
|-----------------|--------------------------------|--------------|
| | 富荣医药健康混合发起A | 富荣医药健康混合发起C |
| 1. 本期已实现收益 | -1,398,085.23 | -113,372.05 |
| 2. 本期利润 | -1,838,583.08 | -159,815.23 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1312 | -0.1277 |
| 4. 期末基金资产净值 | 12,764,786.20 | 1,009,088.54 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8687 | 0.8678 |

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

富荣医药健康混合发起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 | -12.84% | 1.20% | -14.41% | 1.24% | 1.57% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.13% | 1.17% | -13.24% | 1.24% | 0.11% | -0.07% |

富荣医药健康混合发起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 | -12.92% | 1.20% | -14.41% | 1.24% | 1.49% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.22% | 1.17% | -13.24% | 1.24% | 0.02% | -0.07% |

注：本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。

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

富荣医药健康混合发起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



富荣医药健康混合发起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：①本基金的基金合同于 2022 年 06 月 28 日生效，截至 2022 年 09 月 30 日，本基金成立未满 1 年。

②本基金的建仓期为 6 个月，截至 2022 年 09 月 30 日，本基金建仓期尚未结束。

§ 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 | | |
| 李黄海 | 基金经理 | 2022-06-28 | - | 16 | 博士研究生，持有基金从业资格，中国国籍。曾任摩根士丹利华鑫量化投资部投资经理、平安基金量化投资部总监等职务。2020年7月加入富荣基金。 |

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（包括当日内、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

本基金的投资策略，是基于既定的New Beta投资理念：

（1）基金属于相对收益产品，其收益主要来源于医药行业长期显著的Beta收益，因此基金成立后至2022年7月1日就完成了建仓，进入正常的投资运作状态。

（2）基金收益的另一个来源于量化选股模型所创造超额收益。

（3）辅助以有限度的量化择时策略。

基金成立伊始，在本报告期间，就遭遇了医药行业的大幅下跌行情。基金的投资采取了较为保守的投资策略，以降低组合系统性风险为主要目标。一方面，报告期间，股票仓位平均约为87.2%，期末（2022年9月30日）股票仓位为81.84%，处于中等水平；另一方面，量化选股组合偏重价值风格，即以低估值医药个股为主。基金的投资组合整体而言处于防守状态，因此相对于同期业绩比较基准而言，我们在报告期间，A类创造了+1.57%的超额收益，C类创造了+1.49%的超额收益。

我们对于中国A股在今年第四季度的走势，仍持有谨慎保守的看法，因此对于本基金的投资，主要矛盾在于防范系统性风险，基金的股票仓位仍会处于较为灵活、中等的水平，股票组合选股方面仍以充分分散风险为主要目的，等待更好的时机，长线布局中国医药行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣医药健康混合发起A基金份额净值为0.8687元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.84%，同期业绩比较基准收益率为-14.41%；截至报告期末富荣医药健康混合发起C基金份额净值为0.8678元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.92%，同期业绩比较基准收益率为-14.41%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年。

§ 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 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 11,310,322.21 | 81.84 |
| | 其中：股票 | 11,310,322.21 | 81.84 |
| 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 | 1,798,589.51 | 13.01 |
| | 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 | 469,681.56 | 3.40 |
| 8 | 其他资产 | 241,511.23 | 1.75 |
| 9 | 合计 | 13,820,104.51 | 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 | 9,230,287.21 | 67.01 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|-------|
| 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 | 208,208.00 | 1.51 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,230,101.00 | 8.93 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 641,726.00 | 4.66 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 11,310,322.21 | 82.11 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

| 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 | 300206 | 理邦仪器 | 19,800 | 248,490.00 | 1.80 |
| 2 | 002603 | 以岭药业 | 10,800 | 234,468.00 | 1.70 |
| 3 | 603301 | 振德医疗 | 5,275 | 232,047.25 | 1.68 |
| 4 | 002653 | 海思科 | 12,000 | 229,920.00 | 1.67 |
| 5 | 688217 | 睿昂基因 | 5,600 | 223,552.00 | 1.62 |
| 6 | 300529 | 健帆生物 | 4,600 | 223,008.00 | 1.62 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 7 | 688677 | 海泰新光 | 2,000 | 223,000.00 | 1.62 |
| 8 | 688389 | 普门科技 | 14,100 | 222,780.00 | 1.62 |
| 9 | 603882 | 金城医学 | 3,500 | 221,830.00 | 1.61 |
| 10 | 301122 | 采纳股份 | 3,500 | 221,130.00 | 1.61 |

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估值期货。

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 | 240,490.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,020.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 241,511.23 |

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

本基金本报告期末前十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

| | 富荣医药健康混合发起 A | 富荣医药健康混合发起 C |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 11,609,187.79 | 1,252,250.48 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,230,876.03 | 183,566.35 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 145,169.22 | 272,943.50 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 14,694,894.60 | 1,162,873.33 |

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

§ 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

单位：份

| | 富荣医药健康混合发起A | 富荣医药健康混合发起C |
|--------------------------|--------------|-------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 5,002,833.90 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 5,002,833.90 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 34.04 | - |

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，基金总份额为分级总份额。

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 报告期末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 | 5,002,833.90 | 31.55% | 5,002,833.90 | 31.55% | 3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 2,000,472.60 | 12.62% | 2,000,472.60 | 12.62% | 3年 |
| 基金经理等人员 | 3,000,708.62 | 18.92% | 3,000,708.62 | 18.92% | 3年 |
| 基金管理人股东 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | - |
| 其他 | 5,853,752.81 | 36.91% | 0.00 | 0.00% | - |
| 合计 | 15,857,767.93 | 100.00% | 10,004,015.12 | 63.09% | - |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 | 20220701-20220930 | 5,002,833.90 | - | - | 5,002,833.90 | 31.55% |
| 个人 | 1 | 20220701-20220801; 20220804-20220807 | 3,000,708.62 | 1,874.81 | - | 3,002,583.43 | 18.93% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本报告期本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况，未来或存在如下风险，敬请投资者留意：（1）赎回申请延期办理的风险 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。（2）基金资产净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。（3）提前终止基金合同的风险 《基金合同》生效满3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，《基金合同》应当终止；《基金合同》生效满3年后继续存续的，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5,000万元情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会；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。（4）基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，基金投资可能面临一定困难。</p> | | | | | | | |

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人公告：总经理、首席信息官高峰于2022年8月15日离任，董事长杨小舟代行总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 10.1.1 中国证监会批准富荣医药健康混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 10.1.2 《富荣医药健康混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 10.1.3 《富荣医药健康混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 10.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 10.1.5 报告期内富荣医药健康混合型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

10.3 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

2022年10月26日