

# 富荣基金睿选2号集合资产管理计划

2024年第2季度报告

2024年06月30日

资产管理人:富荣基金管理有限公司

资产托管人:中国工商银行股份有限公司深圳市分行

报告送出日期:2024年07月19日

## 1 资产管理计划产品概况

资产管理计划合同生效日	2020年08月18日
报告期末资产管理计划份额总额	2,114,852.26份
风险收益特征	本计划为固定收益类资产管理计划，属于中等风险等级（R3）。
资产管理人	富荣基金管理有限公司
资产托管人	中国工商银行股份有限公司深圳市分行

## 2 投资组合报告

### 2.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,636,844.45	65.74
3	固定收益投资	844,234.67	33.91
	其中：债券	844,234.67	33.91
	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	7,663.20	0.31
8	其他资产	1,051.45	0.04
9	合计	2,489,793.77	100.00

注：本报告期内“其他资产”为存出保证金和应收基金红利的合计数。

## 3 管理人报告

### 3.1 投资经理（或投资经理小组）简介

姓名	职务	说明

过秀	投资经理	硕士研究生学历，曾任职于招商基金、国海证券、世纪证券、摩根士丹利华鑫基金，主要从事债券研究及债券交易工作，在固收投研方面有深入的理论研究及丰富的实战经验；对产品头寸、流动性管理及风险控制有较丰富的经验。现任富荣基金管理有限公司专户投资经理。该投资经理已取得基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录及职业操守，且最近三年内未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，无兼职情况。
----	------	--

### 3.2 公平交易专项说明

#### 3.2.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本资产管理计划管理人严格执行了《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。

#### 3.2.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本资产管理计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4 报告期内资产管理计划的投资表现

截止本报告期末，该产品单位净值1.1731，净值季度增长率为0.4194%。

### 5 产品运用杠杆情况

无

### 6 两费及业绩报酬说明

#### 1、资产管理人的管理费

本计划的固定管理费按前一日本资产管理计划资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div 365$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日本资产管理计划资产净值

本计划的管理费自资产管理计划成立日起，按日计提，按季支付。由资产托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在计划成立后每季初的第三个工作日按照指定的账户路径一次性支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进

行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若委托财产现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。计划展期的，管理费仍然按上述约定计提支付。

## 2、资产托管人的托管费

本计划的托管费按前一日本资产管理计划资产净值的0.02%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div 365$$

H为每日应计提的托管费

E为前一日本资产管理计划资产净值

本计划的托管费自资产管理计划成立日起，每日计提，按季支付。由资产托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在计划成立后每季初的第三个工作日按照指定的账户路径一次性支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若委托财产现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的托管费。计划展期的，托管费仍然按上述约定计提支付。

## 3、资产管理人业绩报酬

3.1在本计划分红日、终止日（含提前终止日）及投资者退出日，若持有期年化收益率大于业绩报酬计提基准，则管理人对超出部分提取20%作为超额业绩报酬；

### 3.2具体计算方法：

1) r为本计划业绩报酬计提基准，本计划成立时的业绩报酬计提基准初始值为6.3%，根据市场情况的变化，管理人有权发布公告后续调整业绩报酬计提基准，管理人需要至少提前一个工作日发布公告并及时通知托管人及相关服务机构；业绩报酬计提基准的调整频率不得高于本计划的开放频率。

2) 按投资者每笔参与份额分别计算实际年化收益率并计提业绩报酬；

3) 符合业绩报酬计提条件时，在业绩报酬计提基准日（本计划分红日、终止日及投资者退出日）计提业绩报酬；

4) 分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

5) 在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。业绩报酬计提份额采取先进先出法，最早申购的份额，在赎回时最先退出，计提业绩报酬根据相应份额的实际年化收益率提取；

6) 在单个业绩报酬计算期间内，若相应份额的实际年化收益率高于或等于r，则超过部分提取20%作为业绩报酬；

7) 业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次。因投资者退出集合计划或本计划终止的,按照合同约定提取业绩报酬的,不受前述提取频率的限制。

8) 每笔份额对应的实际年化收益率的计算方法如下:

$$R = (A - M) \div N \div T \times 365 \times 100\%$$

R为实际年化收益率

A为本次业绩报酬计提基准日的累计单位净值

M为上一个业绩报酬计提基准日的累计单位净值

N为上一个业绩报酬计提基准日的单位净值

T为该计划份额持有人上一个业绩报酬计提基准日(含)至本次业绩报酬计提基准日(不含)之间的实际天数

9) 每笔份额的业绩报酬的计算公式如下:

年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式
$R < r$	0	$E = 0$
$R \geq r$	20%	$E = (R - r) \times C \times T \div 365 \times 20\%$

E为业绩报酬, R为年化收益率, C为投资者当日某笔退出份额数量或业绩报酬计提基准日持有的某笔份额数量 $\times$ 上一个业绩报酬计提基准日该笔份额的单位净值, T为投资者持有该笔份额自上一个业绩报酬计提基准日至本次业绩报酬计提基准日之间的实际天数。若投资者在当日退出份额或业绩报酬计提基准日需计提业绩报酬的份额包含多笔参与份额的,则各笔参与份额按前述公式分别计算应计提的业绩报酬,合并计提。

由资产管理人在投资者分红、退出或资产管理计划终止时,根据业绩报酬计算规则,经管理人注册登记系统处理后,扣除应计提业绩报酬(如有),并划拨至合同指定的投资顾问收款账户。就业绩报酬,由管理人计算、复核,托管人以管理人划款指令数额为准进行划付。

## 7 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

本资产管理计划本报告期内未进行收益分配。

## 8 投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项

本资产管理计划本报告期内无一般及重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项。

## 9 托管人履职报告

本报告期内,托管人在对富荣基金睿选2号集合资产管理计划的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定,不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

本报告期内，托管人对管理人编制和披露的富荣基金睿选2号集合资产管理计划管理报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

富荣基金管理有限公司

2024年07月19日