

富荣福耀混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 31 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。本中期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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 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	50
7.7 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	50
7.8 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	50
7.9 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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

8.3 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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
11.1 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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣福耀混合型证券投资基金	
基金简称	富荣福耀混合	
基金主代码	012876	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年12月27日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	146,256,766.02份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C
下属分级基金的交易代码	012876	012877
报告期末下属分级基金的份额总额	75,608.34份	146,181,157.68份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对行业及公司深入的研究分析，精选优质上市公司，在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%
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。

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	富荣基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	任晓伟	帅芳
	联系电话	0755-84356633	021-38031815
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话	400-685-5600	021-38917599-5	
传真	0755-83230787	021-38677819	
注册地址	广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号	
办公地址	深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼	
邮政编码	518038	200041	
法定代表人	王亦伟	朱健	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.furamc.com.cn/
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富荣基金管理有限公司	深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期
	(2024年01月01日-2024年06月30日)

	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C
本期已实现收益	-30,347.73	-15,975,339.57
本期利润	-13,464.79	-28,472,783.83
加权平均基金份额本期利润	-0.1235	-0.1948
本期加权平均净值利润率	-19.66%	-30.87%
本期基金份额净值增长率	-24.78%	-24.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-30,782.73	-60,406,988.92
期末可供分配基金份额利润	-0.4071	-0.4132
期末基金资产净值	44,825.61	85,774,168.76
期末基金份额净值	0.5929	0.5868
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-40.71%	-41.32%

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期末可供分配利润是采用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

富荣福耀混合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
过去一个月	-5.80%	1.47%	-2.13%	0.34%	-3.67%	1.13%
过去三个月	-7.71%	1.69%	-1.16%	0.52%	-6.55%	1.17%
过去六个月	-24.78%	2.34%	1.45%	0.62%	-26.23%	1.72%

过去一年	-28.41%	1.70%	-5.95%	0.61%	-22.46%	1.09%
自基金合同生效起至今	-40.71%	1.23%	-20.03%	0.73%	-20.68%	0.50%

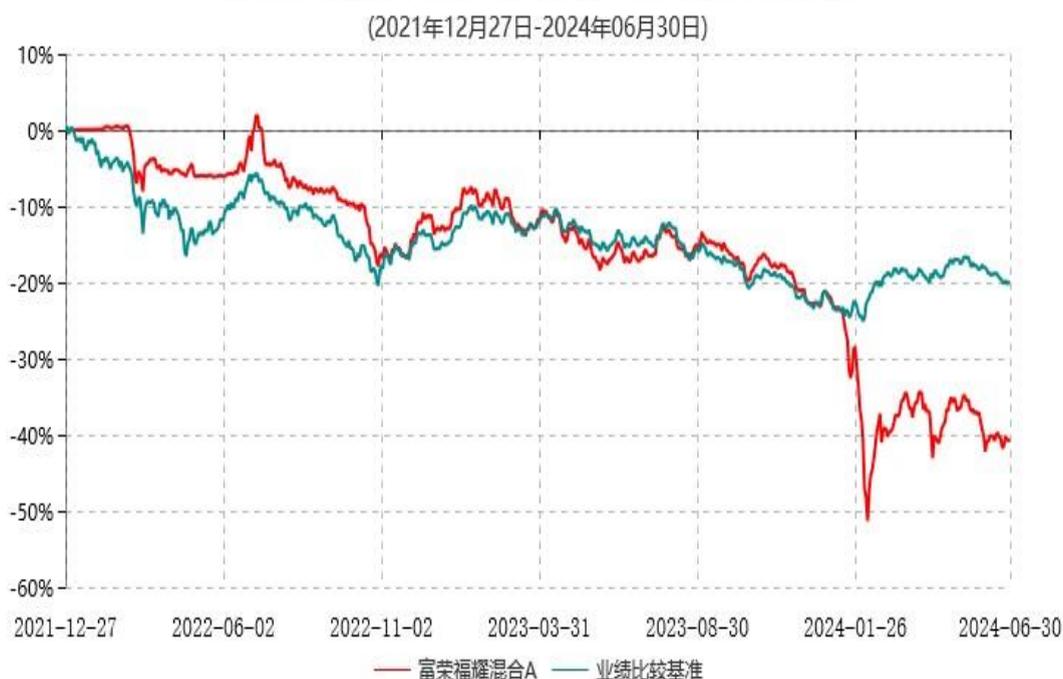
富荣福耀混合C

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
过去一个月	-5.84%	1.47%	-2.13%	0.34%	-3.71%	1.13%
过去三个月	-7.79%	1.70%	-1.16%	0.52%	-6.63%	1.18%
过去六个月	-24.93%	2.34%	1.45%	0.62%	-26.38%	1.72%
过去一年	-28.72%	1.69%	-5.95%	0.61%	-22.77%	1.08%
自基金合同生效起至今	-41.32%	1.23%	-20.03%	0.73%	-21.29%	0.50%

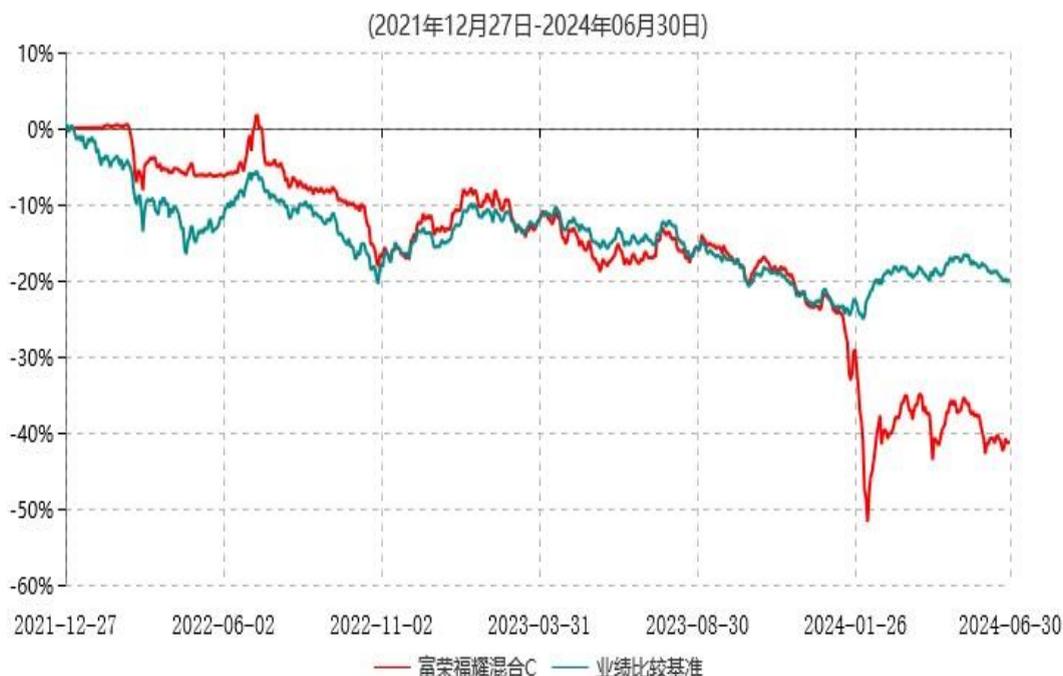
注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%

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

富荣福耀混合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



富荣福耀混合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



§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

富荣基金管理有限公司成立于2016年1月25日，是中国证监会批准成立的国内第101家公募基金管理公司。公司注册地为广州市南沙区，办公地位于深圳市福田区八卦岭八卦四路安吉尔大厦24楼，注册资本金人民币2亿元。富荣基金定位于“综合金融服务商”，围绕客户需求，贯彻投资人利益优先原则，秉持“规范创造价值，创新推动成长”的经营理念，努力打造企业核心竞争力，整合产业上下游资源，为各类投资者提供充分满足个性需求的产品，并以稳定、持续、优秀的投资业绩和全面、及时、优质的服务回报投资者的信任，与投资者共同分享中国经济发展的成果，致力成为受人尊重、有价值的综合金融服务企业领先者。

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		
邓宇翔	权益投资部总经	2021-12-27	2024-04-18	17.5	硕士研究生，持有基金从业资格证

	理、基金经理				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。
李黄海	基金经理	2023-12-12	-	17.5	博士研究生，持有基金从业资格证书，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。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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 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 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

上半年市场整体震荡下行。1月份市场延续去年下跌趋势，大盘缩量下跌，小微盘风格受系统性风险影响全面大跌；2-3月市场快速反弹，宽基ETF显著放量，流动性、风险偏好有所改善，但指数在涨至年前点位区间的时候斜率明显放缓；4月成长价值表现均衡，中下旬新“国九条”发布，伴随北向资金大幅净流入，市场风险偏好回升；5月份，各地出台房地产新政策以刺激房产销量，房地产指数在5月下旬创年内新高；6月份，部分宏观经济数据不及预期，地产新政预期逐渐被消化，伴随着小微盘风格出现数次恐慌性下跌，市场陷入缩量下跌的调整阶段。

因子层面，上半年市场风险偏好整体偏低，红利、估值风格表现较好；分析师、盈利类因子在2-4月份财报密集发布时期表现强势；市值、价量、成长类因子受小微盘回撤影响，上半年整体表现较差。

报告期内，本基金采用多种量化策略进行分散化投资，力争为投资者创造长期稳定的超额收益。本基金在策略上整体偏向小市值，年初受小微盘风格系统性回撤的影响较大，4月份开始本基金将部分仓位转换为以大盘蓝筹个股为主的深度价值策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣福耀混合A基金份额净值为0.5929元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-24.78%，同期业绩比较基准收益率为1.45%；截至报告期末富荣福耀混合C基金份额净值为0.5868元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-24.93%，同期业绩比较基准收益率为1.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，短期来看，我们认为“确定性资产”或将成为市场共识。宏观经济疲软、地缘政治风险中枢上移，市场的“不确定性”上升。新“国九条”的颁布限制了小微盘股的热点炒作，投资者对“确定性”的追求或已成为趋势，而高ROE、高股息、低波动的核心资产今年以来的良好表现印证了这一观点。长期来看，我们仍然看好小市值个股的beta。经历了年初小微盘风格的大幅回撤后，小盘股拥挤度大幅降低，当前的小市值个股具备一定的配置价值。但需要注意的是在新“国九条”背景下，部分个股存在较大退市风险，因此我们认为应适当增加基本面因子的权重。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一

同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、基金事务部、监察稽核部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,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,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资,且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;本基金各类基金份额在费用收取上不同,其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

截止2024年6月30日,根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期未有收益分配事项。

4.8 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 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,国泰君安证券股份有限公司(以下称"本托管人")在富荣福耀混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富荣福耀混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	5,988,172.22	6,623,036.95
结算备付金		50,704.49	22,100,448.30
存出保证金		1,323,242.20	8,502,873.38
交易性金融资产	6.4.7.2	63,634,061.98	77,367,539.65
其中：股票投资		63,634,061.98	77,367,539.65
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,000,150.00	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		160.00	10.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		85,996,490.89	114,593,908.28
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		151.35	-
应付管理人报酬		42,639.17	57,957.37
应付托管费		14,213.06	19,319.12
应付销售服务费		28,411.34	38,615.82
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	6.4.7.5	92,081.60	180,000.00
负债合计		177,496.52	295,892.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	146,256,766.02	146,210,926.97
未分配利润	6.4.7.7	-60,437,771.65	-31,912,911.00
净资产合计		85,818,994.37	114,298,015.97
负债和净资产总计		85,996,490.89	114,593,908.28

注：报告截止日2024年6月30日，富荣福耀混合型证券投资基金A类基金份额净值0.5929元，富荣福耀混合型证券投资基金C类基金份额净值0.5868元，基金份额总额146,256,766.02份，其中富荣福耀混合型证券投资基金A类基金份额75,608.34份，富荣福耀混合型证券投资基金C类基金份额146,181,157.68份。

6.2 利润表

会计主体：富荣福耀混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
一、营业总收入		-27,849,788.81	-6,828,009.60
1.利息收入		174,226.59	136,373.71
其中：存款利息收入	6.4.7.8	69,872.06	120,475.08
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		104,354.53	15,898.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-15,547,028.58	189,661.96
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-16,026,374.31	-1,317,661.94
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	479,345.73	1,507,323.90
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.15	-12,480,561.32	-7,154,107.07
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,574.50	61.80
减：二、营业总支出		636,459.81	1,056,230.92
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	273,541.10	483,896.22
2.托管费	6.4.10.2.2	91,180.40	161,298.74
3.销售服务费	6.4.10.2.3	182,230.71	321,775.81
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	89,507.60	89,260.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,486,248.62	-7,884,240.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,486,248.62	-7,884,240.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-28,486,248.62	-7,884,240.52

6.3 净资产变动表

会计主体：富荣福耀混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	146,210,926.97	-31,912,911.00	114,298,015.97
二、本期期初净资产	146,210,926.97	-31,912,911.00	114,298,015.97
三、本期增减变动额	45,839.05	-28,524,860.65	-28,479,021.60

(减少以“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	-28,486,248.62	-28,486,248.62
(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)	45,839.05	-38,612.03	7,227.02
其中: 1.基金申购款	943,548.38	-393,745.18	549,803.20
2.基金赎回款	-897,709.33	355,133.15	-542,576.18
(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	146,256,766.02	-60,437,771.65	85,818,994.37
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	196,266,997.77	-25,931,143.53	170,335,854.24
二、本期期初净资产	196,266,997.77	-25,931,143.53	170,335,854.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-48,888,853.47	-123,666.39	-49,012,519.86
(一)、综合收益总额	-	-7,884,240.52	-7,884,240.52
(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)	-48,888,853.47	7,760,574.13	-41,128,279.34
其中: 1.基金申购款	1,200,959.71	-170,643.05	1,030,316.66
2.基金赎回款	-50,089,813.18	7,931,217.18	-42,158,596.00
(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	147,378,144.30	-26,054,809.92	121,323,334.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

杨小舟

黄文飞

黄文飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富荣福耀混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2021]2091号文《关于准予富荣福耀混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富荣基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2021年12月27日正式生效，首次设立募集规模303,889,062.73份基金份额。本基金为契约型开放式基金。本基金管理人为富荣基金管理有限公司，登记机构为富荣基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）。

根据《富荣福耀混合型证券投资基金基金合同》和《富荣福耀混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。A类基金份额类别为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用；C类基金份额为从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。

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（含主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票）、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、次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、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、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。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：股票资产占基金资产的比例为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2024年6月30日及2023年12月31日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日和2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

(4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	5,988,172.22
等于：本金	5,985,478.41
加：应计利息	2,693.81
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	5,988,172.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	79,065,645.36	-	63,634,061.98	-15,431,583.38
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	79,065,645.36	-	63,634,061.98	-15,431,583.38

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,000,150.00	-
银行间市场	-	-
合计	15,000,150.00	-

6.4.7.4.2 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无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
其他应付	2,574.00
合计	92,081.60

6.4.7.6 实收基金**6.4.7.6.1 富荣福耀混合A**

金额单位：人民币元

项目 (富荣福耀混合A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
-----------------	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,951.02	83,951.02
本期申购	525,630.53	525,630.53
本期赎回（以“-”号填列）	-533,973.21	-533,973.21
本期末	75,608.34	75,608.34

6.4.7.6.2 富荣福耀混合C

金额单位：人民币元

项目 (富荣福耀混合C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,126,975.95	146,126,975.95
本期申购	417,917.85	417,917.85
本期赎回（以“-”号填列）	-363,736.12	-363,736.12
本期末	146,181,157.68	146,181,157.68

注：申购包含基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 富荣福耀混合A

单位：人民币元

项目 (富荣福耀混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,545.54	-1,231.88	-17,777.42
本期期初	-16,545.54	-1,231.88	-17,777.42
本期利润	-30,347.73	16,882.94	-13,464.79
本期基金份额交易产生的变动数	23,755.91	-23,296.43	459.48
其中：基金申购款	-135,392.23	-76,391.64	-211,783.87
基金赎回款	159,148.14	53,095.21	212,243.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,137.36	-7,645.37	-30,782.73

6.4.7.7.2 富荣福耀混合C

单位：人民币元

项目 (富荣福耀混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-29,773,374.70	-2,121,758.88	-31,895,133.58
本期期初	-29,773,374.70	-2,121,758.88	-31,895,133.58
本期利润	-15,975,339.57	-12,497,444.26	-28,472,783.83
本期基金份额交易产生的变动数	-7,413.81	-31,657.70	-39,071.51
其中：基金申购款	-113,153.03	-68,808.28	-181,961.31
基金赎回款	105,739.22	37,150.58	142,889.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-45,756,128.08	-14,650,860.84	-60,406,988.92

6.4.7.8 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06月30日
活期存款利息收入	51,324.23
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	10,845.31
其他	7,702.52
合计	69,872.06

注：其他为券商保证金利息收入。

6.4.7.9 股票投资收益**6.4.7.9.1 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06月30日
卖出股票成交总额	155,942,154.97

减：卖出股票成本总额	171,564,429.70
减：交易费用	404,099.58
买卖股票差价收入	-16,026,374.31

6.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	479,345.73
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	479,345.73

6.4.7.15 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06月30日
1.交易性金融资产	-12,480,561.32
——股票投资	-12,480,561.32
——债券投资	-
——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	-12,480,561.32

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	3,574.50
合计	3,574.50

注：本基金的A类基金份额、C类基金份额的赎回费率按基金份额持有期限递减，就A类基金份额，对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期不少于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费总额的50%计入基金财产；就C类基金份额，收取的赎回费全额计入基金财产。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
合计	89,507.60

6.4.7.19 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富荣基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30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

国泰君安 证券股份 有限公司	326,253,668.32	100.00%	312,845,390.39	100.00%
----------------------	----------------	---------	----------------	---------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 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06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30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
国泰君安 证券股份 有限公司	1,442,557,000.00	100.00%	35,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 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06月30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

国泰君安 证券股份 有限公司	319,639.00	100.00%	-	-
关联方名 称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30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
国泰君安 证券股份 有限公司	226,010.80	100.00%	-	-

注：上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费及经手费后的净额列示。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	273,541.10	483,896.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	217.07	741.13
应支付基金管理人的净管理费	273,324.03	483,155.09

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

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06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	91,180.40	161,298.74

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 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		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	182,070.49	182,070.49
国泰君安证券股份有限公司	0.00	5.63	5.63
合计	0.00	182,076.12	182,076.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	321,609.26	321,609.26
国泰君安证券股份有限公司	0.00	33.54	33.54
合计	0.00	321,642.80	321,642.80

注：基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为前一日C类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.4.2 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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 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06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	5,988,172.22	51,324.23	14,943,992.24	80,885.23

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安证券转存于交通银行上海交银大厦支行，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生在承销期内参与关联方承销的证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金于本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这

些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险控制委员会为核心的，由督察长、经理层、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；督察长独立行使督察权利，负责公司及其基金运作的监察稽核工作，直接对董事会负责；经理层下设投资决策委员会、风险管理委员会、IT治理委员会、产品委员会、专户业务评审委员会、自有资金投资决策委员会、估值委员会等，协助总经理对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。

6.4.13.2 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建立了内部评级体系和交易对手库，对投资品种进行内部评级并分散化投资，对交易对手实行准入和分级管理，以控制相应的信用风险。

于2024年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券。（2023年12月31日：同）

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于交易所或银行间市场上市的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能变现。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,988,172.22	-	-	-	5,988,172.22
结算备付金	50,704.49	-	-	-	50,704.49
存出保证金	1,323,242.20	-	-	-	1,323,242.20
交易性金融资产	-	-	-	63,634,061.98	63,634,061.98
买入返售金融资产	15,000,150.00	-	-	-	15,000,150.00
应收申购款	-	-	-	160.00	160.00
资产总计	22,362,268.91	-	-	63,634,221.98	85,996,490.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	151.35	151.35
应付管理人报酬	-	-	-	42,639.17	42,639.17
应付托管费	-	-	-	14,213.06	14,213.06
应付销售服务费	-	-	-	28,411.34	28,411.34
其他负债	-	-	-	92,081.60	92,081.60
负债总计	-	-	-	177,496.52	177,496.52
利率敏感度缺口	22,362,268.91	-	-	不适用	不适用
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	6,623,036.95	-	-	-	6,623,036.95
结算备付金	22,100,448.30	-	-	-	22,100,448.30
存出保证金	8,502,873.38	-	-	-	8,502,873.38
交易性金融资产	-	-	-	77,367,539.65	77,367,539.65
应收申购款	-	-	-	10.00	10.00
资产总计	37,226,358.63	-	-	77,367,549.65	114,593,908.28
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	57,957.37	57,957.37
应付托管费	-	-	-	19,319.12	19,319.12
应付销售服务费	-	-	-	38,615.82	38,615.82
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	295,892.31	295,892.31
利率敏感度缺口	37,226,358.63	-	-	不适用	不适用

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2023年12月31日：同）

6.4.13.4.2 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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证券，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30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	63,634,061.98	74.15	77,367,539.65	67.69
交易性金融资产	-	-	-	-

一基金投资				
交易性金融资产 一债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产 一贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产一 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	63,634,061.98	74.15	77,367,539.65	67.69

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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06月30日	上年度末 2023年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	5,979,906.23	6,426,639.35
	基金业绩比较基准下降5%	-5,979,906.23	-6,426,639.35

注：基金业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	63,634,061.98	77,312,701.77
第二层次	-	5,143.11
第三层次	-	49,694.77
合计	63,634,061.98	77,367,539.65

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

(2) 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

(3) 财务报表的批准

本财务报表已于2024年8月29日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 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	63,634,061.98	74.00
	其中：股票	63,634,061.98	74.00
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	15,000,150.00	17.44
	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	6,038,876.71	7.02
8	其他各项资产	1,323,402.20	1.54
9	合计	85,996,490.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	430,717.00	0.50
B	采矿业	-	-
C	制造业	45,098,676.86	52.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,976,795.00	2.30
F	批发和零售业	1,973,683.00	2.30
G	交通运输、仓储和邮政业	219,802.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,891,027.13	5.70
J	金融业	2,883,647.00	3.36

K	房地产业	600,974.00	0.70
L	租赁和商务服务业	1,401.99	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,826,731.00	2.13
N	水利、环境和公共设施管理业	3,519,151.00	4.10
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	211,456.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	63,634,061.98	74.15

7.2.2 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投资股票。

7.3 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	600309	万华化学	45,200	3,654,872.00	4.26
2	600519	贵州茅台	2,300	3,374,997.00	3.93
3	601318	中国平安	45,500	1,881,880.00	2.19
4	600941	中国移动	16,700	1,795,250.00	2.09
5	000858	五粮液	9,800	1,254,792.00	1.46
6	000333	美的集团	17,400	1,122,300.00	1.31
7	600036	招商银行	29,300	1,001,767.00	1.17
8	600276	恒瑞医药	23,600	907,656.00	1.06
9	600887	伊利股份	33,400	863,056.00	1.01
10	600585	海螺水泥	34,700	818,573.00	0.95
11	000538	云南白药	15,800	808,170.00	0.94
12	601669	中国电建	116,600	651,794.00	0.76

13	600690	海尔智家	15,900	451,242.00	0.53
14	002415	海康威视	12,200	377,102.00	0.44
15	000002	万科A	53,800	372,834.00	0.43
16	002857	三晖电气	20,800	286,832.00	0.33
17	603458	勘设股份	45,100	254,815.00	0.30
18	301125	腾亚精工	25,300	250,217.00	0.29
19	300889	爱克股份	21,900	245,718.00	0.29
20	603042	华脉科技	23,300	243,252.00	0.28
21	300844	山水比德	8,900	235,850.00	0.27
22	301197	工大科雅	17,900	234,848.00	0.27
23	300710	万隆光电	15,300	232,101.00	0.27
24	688655	迅捷兴	22,100	232,050.00	0.27
25	300920	润阳科技	15,400	231,616.00	0.27
26	688659	元琛科技	38,600	231,600.00	0.27
27	688681	科汇股份	22,600	230,746.00	0.27
28	688565	力源科技	49,000	229,810.00	0.27
29	301273	瑞晨环保	14,700	228,879.00	0.27
30	605178	时空科技	13,900	228,238.00	0.27
31	301024	霍普股份	11,500	228,160.00	0.27
32	000668	荣丰控股	37,400	228,140.00	0.27
33	301053	远信工业	11,400	227,544.00	0.27
34	301001	凯淳股份	12,900	227,427.00	0.27
35	688011	新光光电	15,000	227,250.00	0.26
36	300839	博汇股份	40,300	226,889.00	0.26
37	301198	喜悦智行	28,300	226,683.00	0.26
38	300886	华业香料	13,800	226,596.00	0.26
39	301057	汇隆新材	19,800	226,512.00	0.26
40	688004	博汇科技	20,683	226,478.85	0.26
41	300412	迦南科技	78,600	226,368.00	0.26
42	300838	浙江力诺	22,000	226,160.00	0.26
43	300665	飞鹿股份	44,600	226,122.00	0.26

44	300749	顶固集创	42,600	225,780.00	0.26
45	301300	远翔新材	10,300	225,673.00	0.26
46	301027	华蓝集团	25,500	225,420.00	0.26
47	603045	福达合金	22,700	225,411.00	0.26
48	301234	五洲医疗	10,400	225,160.00	0.26
49	301118	恒光股份	15,100	225,141.00	0.26
50	301063	海锅股份	15,700	225,138.00	0.26
51	300995	奇德新材	14,600	225,132.00	0.26
52	002114	罗平锌电	52,800	224,928.00	0.26
53	301113	雅艺科技	11,300	224,757.00	0.26
54	300931	通用电梯	41,000	224,680.00	0.26
55	688448	磁谷科技	11,900	224,672.00	0.26
56	300614	百川畅银	24,700	224,523.00	0.26
57	603272	联翔股份	26,400	224,400.00	0.26
58	003017	大洋生物	13,800	224,388.00	0.26
59	688329	艾隆科技	15,100	224,386.00	0.26
60	301336	趣睡科技	7,600	224,352.00	0.26
61	300594	朗进科技	16,000	224,320.00	0.26
62	301288	清研环境	20,100	224,316.00	0.26
63	300211	亿通科技	42,400	224,296.00	0.26
64	300635	中达安	29,700	224,235.00	0.26
65	301075	多瑞医药	14,100	224,190.00	0.26
66	300640	德艺文创	56,900	224,186.00	0.26
67	688466	金科环境	18,800	224,096.00	0.26
68	002842	翔鹭钨业	43,300	223,861.00	0.26
69	605189	富春染织	21,000	223,860.00	0.26
70	300246	宝莱特	37,000	223,850.00	0.26
71	688229	博睿数据	8,700	223,764.00	0.26
72	688395	正弦电气	15,695	223,653.75	0.26
73	688350	富淼科技	19,600	223,636.00	0.26
74	301081	严牌股份	29,800	223,500.00	0.26

75	301167	建研设计	19,200	223,488.00	0.26
76	688335	复洁环保	27,400	223,310.00	0.26
77	688171	纬德信息	14,800	223,184.00	0.26
78	003003	天元股份	28,000	223,160.00	0.26
79	300960	通业科技	14,800	223,036.00	0.26
80	300535	达威股份	18,900	223,020.00	0.26
81	688669	聚石化学	19,700	223,004.00	0.26
82	300899	上海凯鑫	12,000	222,960.00	0.26
83	002529	海源复材	43,200	222,912.00	0.26
84	002853	皮阿诺	30,000	222,900.00	0.26
85	300658	延江股份	52,800	222,816.00	0.26
85	300050	世纪鼎利	84,400	222,816.00	0.26
87	300334	津膜科技	47,600	222,768.00	0.26
88	688679	通源环境	32,000	222,720.00	0.26
89	688021	奥福环保	24,200	222,640.00	0.26
90	003011	海象新材	16,600	222,606.00	0.26
91	002910	庄园牧场	35,900	222,580.00	0.26
92	603709	中源家居	17,900	222,497.00	0.26
93	688067	爱威科技	15,500	222,425.00	0.26
94	300753	爱朋医疗	20,300	222,285.00	0.26
95	002780	三夫户外	24,600	222,138.00	0.26
96	605081	太和水	19,000	222,110.00	0.26
96	301006	迈拓股份	19,000	222,110.00	0.26
98	688309	恒誉环保	18,524	222,102.76	0.26
99	300883	龙利得	52,500	222,075.00	0.26
100	300912	凯龙高科	23,700	222,069.00	0.26
101	301037	保立佳	25,060	222,031.60	0.26
102	002963	豪尔赛	21,700	221,991.00	0.26
103	301040	中环海陆	22,400	221,984.00	0.26
104	300157	新锦动力	120,500	221,720.00	0.26
105	300478	杭州高新	28,400	221,520.00	0.26

106	603022	新通联	30,400	221,312.00	0.26
107	002826	易明医药	27,900	221,247.00	0.26
108	301010	晶雪节能	19,200	220,992.00	0.26
109	688701	卓锦股份	41,000	220,990.00	0.26
110	688038	中科通达	23,200	220,864.00	0.26
111	603139	康惠制药	17,400	220,806.00	0.26
112	605298	必得科技	26,600	220,780.00	0.26
113	301228	实朴检测	23,600	220,660.00	0.26
114	300030	阳普医疗	59,300	220,596.00	0.26
115	002494	华斯股份	70,700	220,584.00	0.26
116	300955	嘉亨家化	17,400	220,458.00	0.26
117	300405	科隆股份	62,100	220,455.00	0.26
118	600128	苏豪弘业	34,600	220,402.00	0.26
119	300929	华骐环保	30,100	220,332.00	0.26
120	301098	金埔园林	29,100	220,287.00	0.26
121	300804	广康生化	10,100	220,180.00	0.26
122	003027	同兴环保	17,900	220,170.00	0.26
123	688316	青云科技	7,358	220,077.78	0.26
124	600235	民丰特纸	47,800	219,880.00	0.26
125	001202	炬申股份	19,400	219,802.00	0.26
126	000702	正虹科技	51,700	219,725.00	0.26
127	300854	中兰环保	22,100	219,674.00	0.26
128	300165	天瑞仪器	103,600	219,632.00	0.26
129	688367	工大高科	18,000	219,600.00	0.26
130	002713	东易日盛	99,800	219,560.00	0.26
131	002898	赛隆药业	24,800	219,480.00	0.26
132	600802	福建水泥	78,900	219,342.00	0.26
133	300845	捷安高科	20,250	219,307.50	0.26
134	603978	深圳新星	24,500	219,275.00	0.26
135	688455	科捷智能	27,300	219,219.00	0.26
136	300621	维业股份	29,500	219,185.00	0.26

137	688096	京源环保	43,400	219,170.00	0.26
138	688328	深科达	15,400	219,142.00	0.26
139	000632	三木集团	81,100	218,970.00	0.26
140	300877	金春股份	20,200	218,968.00	0.26
140	300703	创源股份	27,100	218,968.00	0.26
142	300237	美晨生态	206,500	218,890.00	0.26
143	688051	佳华科技	13,200	218,856.00	0.26
144	688288	鸿泉物联	14,000	218,820.00	0.25
145	001260	坤泰股份	15,700	218,701.00	0.25
146	300935	盈建科	14,100	218,691.00	0.25
147	301178	天亿马	10,600	218,678.00	0.25
148	600156	华升股份	70,300	218,633.00	0.25
149	300948	冠中生态	24,700	218,595.00	0.25
150	002144	宏达高科	26,000	218,400.00	0.25
151	600287	ST舜天	61,500	218,325.00	0.25
152	688013	天臣医疗	14,700	218,148.00	0.25
153	688379	华光新材	15,911	218,139.81	0.25
154	001211	双枪科技	14,300	217,932.00	0.25
155	688619	罗普特	31,000	217,930.00	0.25
155	603177	德创环保	31,000	217,930.00	0.25
157	603214	爱婴室	19,300	217,897.00	0.25
158	603226	菲林格尔	66,000	217,800.00	0.25
159	688069	德林海	16,200	217,728.00	0.25
159	600793	宜宾纸业	24,300	217,728.00	0.25
161	600883	博闻科技	35,400	217,710.00	0.25
162	688393	安必平	14,200	217,686.00	0.25
163	688178	万德斯	21,100	217,541.00	0.25
164	600493	凤竹纺织	50,000	217,500.00	0.25
165	301105	鸿铭股份	8,700	217,413.00	0.25
166	605069	正和生态	35,400	217,356.00	0.25
167	688129	东来技术	17,400	217,326.00	0.25

168	688251	井松智能	11,700	217,269.00	0.25
169	000590	启迪药业	41,200	217,124.00	0.25
170	688607	康众医疗	17,476	217,051.92	0.25
171	600539	狮头股份	59,600	216,944.00	0.25
172	002205	国统股份	34,600	216,942.00	0.25
173	301079	邵阳液压	17,000	216,920.00	0.25
174	300892	品渥食品	15,900	216,876.00	0.25
175	300970	华绿生物	18,900	216,783.00	0.25
176	605567	春雪食品	28,300	216,778.00	0.25
177	002798	帝欧家居	66,400	216,464.00	0.25
178	688314	康拓医疗	11,500	216,430.00	0.25
179	002370	亚太药业	86,900	216,381.00	0.25
180	301066	万事利	26,700	216,270.00	0.25
181	300086	康芝药业	61,600	216,216.00	0.25
182	688026	洁特生物	21,700	216,132.00	0.25
183	605303	园林股份	32,200	215,740.00	0.25
184	300651	金陵体育	17,800	215,736.00	0.25
185	603810	丰山集团	25,800	215,688.00	0.25
186	002778	中晟高科	20,500	215,660.00	0.25
187	300518	新讯达	29,000	215,470.00	0.25
188	002295	精艺股份	40,500	215,460.00	0.25
189	300391	长药控股	93,200	215,292.00	0.25
190	001231	农心科技	15,300	215,271.00	0.25
191	688217	睿昂基因	10,900	215,166.00	0.25
192	688056	莱伯泰科	9,700	214,952.00	0.25
193	688163	赛伦生物	17,700	214,878.00	0.25
194	688296	和达科技	22,100	214,812.00	0.25
195	603716	塞力医疗	37,800	214,704.00	0.25
196	300992	泰福泵业	13,600	214,608.00	0.25
197	000953	河化股份	92,100	214,593.00	0.25
198	002820	桂发祥	29,000	214,310.00	0.25

199	300564	筑博设计	25,100	214,103.00	0.25
200	688189	南新制药	38,000	213,940.00	0.25
201	300511	雪榕生物	82,600	213,934.00	0.25
202	300198	纳川股份	194,400	213,840.00	0.25
203	603822	嘉澳环保	11,300	213,683.00	0.25
204	600137	浪莎股份	18,000	213,660.00	0.25
205	002397	梦洁股份	111,200	213,504.00	0.25
206	688193	仁度生物	8,120	213,474.80	0.25
207	002094	青岛金王	118,600	212,294.00	0.25
208	688670	金迪克	18,000	212,040.00	0.25
209	301231	荣信文化	11,200	211,456.00	0.25
210	688718	唯赛勃	24,700	211,185.00	0.25
211	688156	路德环境	15,900	210,357.00	0.25
212	603657	春光科技	18,400	209,576.00	0.24
213	300169	天晟新材	45,200	209,276.00	0.24
214	688656	浩欧博	9,100	208,663.00	0.24
215	300716	泉为科技	28,900	207,502.00	0.24
216	601096	宏盛华源	958	3,918.22	0.00
217	603373	安邦护卫	51	1,401.99	0.00
218	603004	鼎龙科技	60	1,017.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600519	贵州茅台	4,018,116.00	3.52
2	600309	万华化学	3,952,461.00	3.46
3	601318	中国平安	1,958,134.00	1.71
4	600941	中国移动	1,715,413.00	1.50

5	600697	欧亚集团	1,429,798.00	1.25
6	000858	五粮液	1,402,180.00	1.23
7	300804	广康生化	1,168,249.99	1.02
8	000333	美的集团	1,147,396.00	1.00
9	000063	中兴通讯	1,135,257.00	0.99
10	600690	海尔智家	1,134,485.00	0.99
11	002415	海康威视	1,122,498.00	0.98
12	000538	云南白药	1,122,395.00	0.98
13	601669	中国电建	1,120,354.00	0.98
14	600887	伊利股份	1,120,084.00	0.98
15	600276	恒瑞医药	1,118,258.60	0.98
16	600585	海螺水泥	1,117,461.00	0.98
17	600036	招商银行	1,116,089.00	0.98
18	600050	中国联通	1,110,424.00	0.97
19	000002	万科A	1,108,043.00	0.97
20	601888	中国中免	1,103,165.00	0.97

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	600519	贵州茅台	4,779,611.00	4.18
2	600309	万华化学	3,346,070.00	2.93
3	000858	五粮液	3,222,336.00	2.82
4	600887	伊利股份	3,072,796.00	2.69
5	600941	中国移动	2,927,458.00	2.56
6	600585	海螺水泥	2,720,752.00	2.38
7	000568	泸州老窖	2,673,845.00	2.34
8	600809	山西汾酒	2,571,539.00	2.25

9	600276	恒瑞医药	2,437,517.00	2.13
10	600690	海尔智家	2,045,769.00	1.79
11	601318	中国平安	1,984,988.00	1.74
12	000338	潍柴动力	1,816,529.00	1.59
13	600048	保利发展	1,367,080.00	1.20
14	600697	欧亚集团	1,320,330.00	1.16
15	600036	招商银行	1,295,502.99	1.13
16	000063	中兴通讯	1,256,571.00	1.10
17	600050	中国联通	1,076,516.00	0.94
18	300804	广康生化	1,051,200.57	0.92
19	300621	维业股份	1,003,180.00	0.88
20	300637	扬帆新材	977,389.00	0.86

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	170,311,513.35
卖出股票收入（成交）总额	155,942,154.97

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行在报告编制日前一年内因未依法履行其他职责及违反外汇管理规定分别受到国家金融监督管理总局深圳监管局及国家外汇管理局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,323,242.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	160.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,323,402.20

7.12.4 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。

7.12.5 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股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
富荣福耀混合A	110	687.35	0.00	0.00%	75,608.34	100.00%
富荣福耀混合C	127	1,151,032.74	146,044,483.34	99.9065%	136,674.34	0.0935%
合计	223	655,859.94	146,044,483.34	99.8549%	212,282.68	0.1451%

注：① 分级基金机构/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）。

② 户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 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	富荣福耀混合A	1,792.88	2.37%
	富荣福耀混合C	497.59	0.00%
	合计	2,290.47	0.00%

注：①分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

②期末基金管理人的从业人员持有本基金占基金总份额比例显示为0是由于保留位数问题导致的。

8.3 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、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	富荣福耀混合A	0~10
	富荣福耀混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富荣福耀混合A	0~10
	富荣福耀混合C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣福耀混合A	富荣福耀混合C
基金合同生效日(2021年12月27日)基金份额总额	74,393.39	303,814,669.34
本报告期期初基金份额总额	83,951.02	146,126,975.95
本报告期基金总申购份额	525,630.53	417,917.85
减：本报告期基金总赎回份额	533,973.21	363,736.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	75,608.34	146,181,157.68

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理(主持工作)。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

10.3 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未出现变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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，本基金管理人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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					
国泰君安	2	326,253,668.32	100.00%	319,639.00	100.00%	-

(1) 基金交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。(2) 基金交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。(3) 报告期内证券交易单元未发生变化。(4) 本基金管理人已于2024年7月1日根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及证券业协会测算结果完成佣金费率调整，相关证券公司选择标准和程序将按新规执行。

10.7.2 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
国泰君安	-	-	1,442,557,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 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	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第4季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-22
2	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增华西证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-22
3	富荣基金管理有限公司关于董事变更的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-01
4	富荣基金管理有限公司关于	证券时报、基金管理人网站、	2024-03-20

	提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	中国证监会基金电子披露网站	
5	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
6	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年年度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-30
7	富荣福耀混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
8	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2024年第1季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-22
9	富荣基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金更新招募说明书及产品资料概要的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23
10	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海云湾基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-18
11	富荣基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金更新产品资料概要的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27
12	富荣基金管理有限公司关于	证券时报、基金管理人网站、	2024-06-28

	旗下基金新增深圳腾元基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站	
--	--	---------------	--

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 - 20240630	146,044,483.34	-	-	146,044,483.34	99.85%

产品特有风险

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，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止合同等，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。

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准富荣福耀混合型证券投资基金设立的文件；
- 12.1.2 《富荣福耀混合型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《富荣福耀混合型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 12.1.5 报告期内富荣福耀混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 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
二〇二四年八月三十一日