

# 富荣中证500指数增强型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司

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 .....	7
4.3 公平交易专项说明 .....	8
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 .....	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 .....	9
§5 投资组合报告 .....	9
5.1 报告期末基金资产组合情况 .....	9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	9
5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	12
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 .....	12
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 .....	12
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 .....	13
§6 开放式基金份额变动 .....	14
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 .....	14
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 .....	14
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 .....	14
§8 影响投资者决策的其他重要信息 .....	14
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 .....	15
§9 备查文件目录 .....	15
9.1 备查文件目录 .....	15
9.2 存放地点 .....	15
9.3 查阅方式 .....	15

## § 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	富荣中证500指数增强
基金主代码	004790
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01月10日
报告期末基金份额总额	7,827,028.06份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证500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，在控制与中证500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	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，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风险、中高预期收益的品种。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	富荣中证500指数增强A	富荣中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	004790	004791
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 616, 704. 53份	6, 210, 323. 53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)	
	富荣中证500指数增强A	富荣中证500指数增强C
1. 本期已实现收益	-12, 948. 61	-102, 895. 39
2. 本期利润	-313, 954. 37	-1, 132, 935. 04
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 1528	-0. 1764
4. 期末基金资产净值	2, 009, 377. 76	7, 681, 324. 52
5. 期末基金份额净值	1. 2429	1. 2369

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

富荣中证500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	-12. 67%	1. 08%	-10. 90%	1. 10%	-1. 77%	-0. 02%

过去六个月	-8.54%	1.31%	-9.13%	1.39%	0.59%	-0.08%
过去一年	-17.01%	1.21%	-18.58%	1.27%	1.57%	-0.06%
过去三年	32.28%	1.37%	15.24%	1.28%	17.04%	0.09%
自基金合同生效起至今	50.14%	1.38%	31.99%	1.33%	18.15%	0.05%

## 富荣中证500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	-12.69%	1.08%	-10.90%	1.10%	-1.79%	-0.02%
过去六个月	-8.59%	1.31%	-9.13%	1.39%	0.54%	-0.08%
过去一年	-17.09%	1.21%	-18.58%	1.27%	1.49%	-0.06%
过去三年	31.85%	1.37%	15.24%	1.28%	16.61%	0.09%
自基金合同生效起至今	49.55%	1.38%	31.99%	1.33%	17.56%	0.05%

注：本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

### 3.2.2 自基金转型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

富荣中证500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

(2019年01月10日-2022年09月30日)



富荣中证500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		
邱紫华	基金经理	2020-08-26	2022-08-15	5	博士研究生，深圳证券交易所金融学博士后，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾参与深圳证券交易所期权产品设计，曾任五矿证券创新业务部量化与衍生品业务负责人/资产管理部-量化投资部投资主办人/证券研究所金融工程分析师。2020年4月加入富荣基金。

郎骋成	研究部总经理、基金经理	2022-08-05	-	16	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。
李天翔	基金经理	2022-08-18	-	3.5	硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任中融基金管理有限公司研究部周期行业研究员，2020年加入富荣基金管理有限公司，历任富荣基金管理有限公司研究部周期行业和医药行业研究员，现任富荣基金管理有限公司基金经理。

#### 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
郎骋成	公募基金	4	2,154,052,869.93	2020-07-16
	私募资产管理计划	3	14,460,499.11	2020-09-22
	其他组合	-	-	-
	合计	7	2,168,513,369.04	-

#### 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

本报告期内，市场波动加剧，风格切换较快。自二季度出口链条和汽车、锂电、光伏等制造业迎来复苏后，受全球地缘政治格局，美联储加息及全球疫情的影响，需求衰退的担忧再度成为全球市场的主旋律。外部经济衰退预期下，二季度的强势板块在三季度迅速走弱。回顾三季度，市场主线再度回到了全球能源主题以及对国内产业政策的博弈上。

因此，我们在行业配置上采取了较为主动的策略，希望基于国内经济和全球宏观基本面的把握，超配符合中长期竞争优势的行业，规避中期维度下风险突出的行业。同时，我们希望通过提高持仓的集中度，来强调个股基本面的重要性。

展望未来，我们认为有两个不确定因素影响市场走势：

第一，从内需角度出发，疫情的持续冲击。受上半年疫情影响，即使在流动性较为宽裕的市场环境下，A股在四月底也创出了新低；随后疫情影响减弱后，市场信心也得以恢复。下一阶段国内对疫情防控和经济发展的平衡是决定内需的重要因素。对于投资而言，挑选受疫情影响较小，业绩增长较为确定的细分领域是我们面对这一不确定因素的应对策略，这需要对阶段性的估值保持高度敏感，对阶段性业绩保持高频跟踪。

第二，从外需角度出发，美联储加息周期下，欧美经济的衰退带来的出口的不确定性。2020年以来，我国的出口数据持续超预期，在全球综合供应链中扮演着越来越重要的角色，出口也成为近几年来拉动我国经济增长的重要动力。面对在经济衰退路上的欧美市场，以及地缘政治影响下的逆全球化和贸易保护，我们需要细究我国企业不同产业链中的竞争格局和潜在风险，锚准刚性需求，寻找在全球大变局下具备竞争优势的公司。

从估值角度，大部分行业已经相当便宜，安全边际较高，同时内外需相继见底后，业绩底部也逐渐形成。我们将在量化多因子选股模型的基础上，继续保持在重点行业和重点公司上的主动超配。



#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣中证500指数增强A基金份额净值为1.2429元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.67%，同期业绩比较基准收益率为-10.90%；截至报告期末富荣中证500指数增强C基金份额净值为1.2369元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.69%，同期业绩比较基准收益率为-10.90%。

#### 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，本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人已向证监会报备，并持续营销。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 (%)
1	权益投资	8,676,384.26	89.36
	其中：股票	8,676,384.26	89.36
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	506,400.76	5.22
8	其他资产	526,923.17	5.43
9	合计	9,709,708.19	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	166,496.00	1.72

B	采矿业	589,440.00	6.08
C	制造业	5,334,621.79	55.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	262,064.00	2.70
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	130,248.00	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	339,400.00	3.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	328,273.12	3.39
J	金融业	514,918.00	5.31
K	房地产业	106,820.00	1.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	109,629.40	1.13
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,881,910.31	81.33

### 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	666,687.95	6.88
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	-	-
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	127,786.00	1.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	794,473.95	8.20

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 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	688180	君实生物	4,091	206,554.59	2.13
2	603198	迎驾贡酒	3,500	196,595.00	2.03
3	002603	以岭药业	9,000	195,390.00	2.02
4	002422	科伦药业	8,800	193,952.00	2.00
5	600765	中航重机	6,320	189,347.20	1.95
6	600079	人福医药	10,700	187,571.00	1.94
7	600233	圆通速递	9,000	186,750.00	1.93
8	600988	赤峰黄金	8,900	180,492.00	1.86
9	600597	光明乳业	16,500	172,755.00	1.78

10	600195	中牧股份	13,000	171,080.00	1.77
----	--------	------	--------	------------	------

### 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	688072	拓荆科技	600	179,100.00	1.85
2	688596	正帆科技	3,833	142,395.95	1.47
3	000733	振华科技	1,200	139,176.00	1.44
4	000573	粤宏远 A	36,200	127,786.00	1.32
5	603002	宏昌电子	23,400	123,552.00	1.27

### 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	514,619.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,303.46
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	526,923.17

### 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

	富荣中证500指数增强A	富荣中证500指数增强C
报告期期初基金份额总额	2,723,934.85	6,600,127.59
报告期期间基金总申购份额	301,689.23	756,490.69
减：报告期期间基金总赎回份额	1,408,919.55	1,146,294.75
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	1,616,704.53	6,210,323.53

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

	富荣中证500指数增强 A	富荣中证500指数增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	1,950,000.00
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	-	1,950,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	31.40

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 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

机 构	1	20220701 - 20220930	1,950,000.00	0.00	0.00	1,950,000.00	24.91%
	2	20220701 - 20220930	2,209,619.21	0.00	0.00	2,209,619.21	28.23%
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>							

注:申购含转换入份额、红利再投资份额;赎回含转换出份额。

## 8.2 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。

## §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中证500指数增强型证券投资基金设立的文件;
- 9.1.2 《富荣中证500指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 9.1.3 《富荣中证500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 报告期内富荣中证500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

2022年10月26日