

# 富荣中证 500 指数增强型证券投资基金

## 清算报告



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

清算报告出具日：2024 年 10 月 15 日

清算报告公告日：2024 年 10 月 22 日

## § 1 重要提示

富荣中证500指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系由富荣福安灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来。富荣福安灵活配置混合型证券投资基金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[2017]731号文《关于准予富荣福安灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册，基金合同于2018年2月13日正式生效。基金管理人为富荣基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经中国证监会证监许可[2018]1655号文《关于准予富荣福安灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册，根据富荣福安灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于2018年12月10日表决通过的《富荣福安灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，富荣福安灵活配置混合型证券投资基金自2019年1月10日起变更为本基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的有关规定及《富荣中证500指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，本基金于2024年8月3日至2024年9月2日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止富荣中证500指数增强型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，此次基金份额持有人大会的计票于2024年9月3日在本基金基金托管人招商银行股份有限公司授权代表的监督及上海市通力律师事务所的见证下进行，并由公证机关深圳市深圳公证处对计票过程及结果进行了公证。根据表决结果，本次会议议案有效通过。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，表决结果及决议生效的公告详见于2024年9月4日刊登在规定媒介上的《富荣中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

根据《富荣中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，为更好地满足投资者的退出需求，在持有人大会决议生效后，本基金于2024年9月4日至2024年9月10日进入赎回选择期。赎回选择期结束后，本基金于2024年9月11日进入清算程序。即本基金的最后运作日为2024年9月10日，并于2024年9月11日进入清算程序。

由本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成本基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## § 2 基金概况

基金名称	富荣中证 500 指数增强型证券投资基金
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（2024 年 9 月 10 日） 基金总份额	1,675,354.07 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。
基金管理人名称	富荣基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

## § 3 基金运作情况

富荣中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")，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[2017]731 号文《关于准予富荣福安灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册，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 2018 年 2 月 13 日正式生效，首次设立募集规模为 202,201,890.71 份基金份额。经中国证监会证监许可[2018]1655 号文《关于准予富荣福安灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》准予变更注册，根据富荣福安灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于 2018 年 12 月 10 日表决通过的《富荣福安灵活配置混合型证券投资基金



转型有关事项的议案》，富荣福安灵活配置混合型证券投资基金自 2019 年 1 月 10 日起变更为本基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的有关规定及《基金合同》、《关于终止富荣中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同有关事项的议案》的约定，本基金的最后运作日为 2024 年 9 月 10 日，并于 2024 年 9 月 11 日进入清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

## § 4 财务会计报告

### 4.1 最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：富荣中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 9 月 10 日

单位：人民币元

	最后运作日 2024 年 9 月 10 日
<b>资产：</b>	
货币资金	193,947.86
结算备付金	-
存出保证金	1,528,324.57
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	-
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>1,722,272.43</b>
<b>负债：</b>	
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	158,385.53
应付管理人报酬	345.64
应付托管费	57.60
应付销售服务费	26.26

应付交易费用	-
应交税费	-
其他负债	75.05
负债合计	158,890.08
所有者权益：	
实收基金	1,675,354.07
未分配利润	-111,971.72
所有者权益合计	1,563,382.35
负债和所有者权益总计	1,722,272.43

注：1、报告截止日 2024 年 9 月 10 日（基金最后运作日），基金份额总额 1,675,354.07 份。A 类基金份额净值人民币 0.9361 元，基金份额总额 894,971.35 份。C 类基金份额净值人民币 0.9298 元，基金份额总额 780,382.72 份。

2、本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了安永华明（2024）专字第 70036562\_H24 号标准无保留意见的审计报告。

## § 5 基金财产分配

自最后运作日后至 2024 年 9 月 13 日清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

### 5.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 5.2 资产处置情况

（1）本基金最后运作日货币资金为人民币 193,947.86 元，其中银行存款本金 193,649.44 元，银行存款应计利息 298.42 元。本基金于清算期间计提应计利息人民币 16.84 元。截至 2024 年 9 月 13 日货币资金为人民币 1,543,643.30 元，其中银行存款本金 1,543,328.04 元，银行存款应计利息 315.26 元。该款项将于清算结束后向基金份额持有人进行分配。

（2）本基金最后运作日存出保证金人民币 1,528,324.57 元，其中本金为人民币 1,528,218.96 元，应计利息为人民币 105.61 元。本基金于清算期间计提存出保证金应计利息人民币 13.43 元。存出保证金本金部分于 2024 年 9 月 11 日支付红利补缴税 2,929.01 元；剩余存出保证金本金 1,525,289.95 元，于 2024 年 9 月 13 日划入本基金托管账户。截至 2024 年 9 月 13 日存出保证金为人民币 119.04 元，其中应计利息 119.04 元。

(3) 银行存款应计利息 315.26 元、存出保证金应计利息 119.04 元，将由基金管理人以自有资金于本基金向基金份额持有人进行清算分配时进行垫付。银行存款应计利息、存出保证金应计利息均为预计金额，可能与实际发生金额存在差异，实际收付均以银行实际结算金额为准。应计利息的最终误差由基金管理人承担，基金管理人垫付的银行存款自有资金到账日起至托管户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在相关账户销户后向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

### 5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 158,385.53 元，2024 年 9 月 11 日确认最后运作日基金份额持有人申请赎回的应付赎回款 16,741.27 元。应付赎回款共计 175,126.80 元，已于 2024 年 9 月 11 日至 2024 年 9 月 13 日清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 345.64 元，已于 2024 年 9 月 11 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 57.60 元，已于 2024 年 9 月 11 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 26.26 元，已于 2024 年 9 月 11 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 75.05 元，其中，银行汇划费为人民币 75.00 元，应付赎回费为人民币 0.05 元。银行汇划费将于清算结束后由基金托管人于托管账户自行扣收；应付赎回费，已于 2024 年 9 月 11 日支付。

(6) 为保护基金份额持有人利益，本基金运作期间（2024 年度）及清算期间所产生的审计费、律师费、信息披露费、公证费、指数使用费由基金管理人承担。

### 5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2024 年 9 月 11 日至 2024 年 9 月 13 日止清算期间
一、清算收益	
利息收入	30.27
投资收益（损失以“-”填列）	-2,929.01
清算收入小计	-2,898.74
二、清算费用	
其他费用	55.00
清算费用小计	55.00



三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	-2,953.74
---------------------	-----------

注：（1）利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2024 年 9 月 11 日起至 2024 年 9 月 13 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息。

（2）投资收益系因本基金处置股票投资所产生的股息红利补缴税款。

（3）其他费用为 2024 年 9 月 11 日起至 2024 年 9 月 13 日止清算期间产生的银行汇划费。

### 5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2024 年 9 月 10 日基金净资产	1,563,382.35
加：清算期间净损益	-2,953.74
加：基金净申购（于 2024 年 9 月 11 日确认的投资者申购申请）	-
减：基金净赎回（于 2024 年 9 月 11 日确认的投资者赎回申请）	16,741.27
二、2024 年 9 月 13 日基金净资产	1,543,687.34

根据《关于终止富荣中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同有关事项的说明》中基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2024 年 9 月 13 日止的剩余财产为人民币 1,543,687.34 元。

自 2024 年 9 月 14 日至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有。因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至划出前一日银行存款产生的利息，该期间利息属全体基金份额持有人所有，将于划出清算款时一并向基金份额持有人分配。自 2024 年 9 月 14 日至清算款划出日划出清算款产生的汇划费亦由基金份额持有人承担。基金管理人垫付的银行存款自有资金到账日起至托管账户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在相关账户销户后向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

## 5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

## § 6 备查文件

### 6.1 备查文件目录

#### 6.1.1 《富荣中证 500 指数增强型证券投资基金清算审计报告》

#### 6.1.2《上海市通力律师事务所关于<富荣中证 500 指数增强型证券投资基金清算报告>的法律意见》

### 6.2 存放地点

本基金管理人的住所。

### 6.3 查阅方式

上述文件可在富荣基金管理有限公司网站上查阅，或者在营业时间内到富荣基金管理有限公司查阅。

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。

客户服务电话：4006855600

网址：<http://www.furamc.com.cn>

富荣中证 500 指数增强型证券投资基金  
基金财产清算小组

2024 年 10 月 22 日





(本页无正文，以下为《富荣中证 500 指数增强型证券投资基金清算报告》签署页)

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

