

富荣福康混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2023 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月25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2023年01月01日起至2023年06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	6
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遵规守信情况的说明	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣福康混合型证券投资基金	
基金简称	富荣福康混合	
基金主代码	005104	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月11日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,782,491.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣福康混合A	富荣福康混合C
下属分级基金的交易代码	005104	005105
报告期末下属分级基金的份额总额	2,329,160.69份	12,453,331.11份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合，在严格控制风险的基础上，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、税收、货币、汇率政策等），并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健收益。
业绩比较基准	中证全债指数收益率*30%+沪深300指数收益率*70%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨小舟	石立平
	联系电话	0755-84356633	010-63639180
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-685-5600	95595
传真		0755-83230787	010-63639132
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		518038	100033
法定代表人		王亦伟	王江

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
---------------	-----

	(2023年01月01日-2023年06月30日)	
	富荣福康混合A	富荣福康混合C
本期已实现收益	-16,493.94	-226,362.20
本期利润	217,036.94	224,213.30
加权平均基金份额本期利润	0.0790	0.0220
本期加权平均净值利润率	7.02%	1.98%
本期基金份额净值增长率	5.96%	5.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	280,413.97	1,298,555.95
期末可供分配基金份额利润	0.1204	0.1043
期末基金资产净值	2,609,574.66	13,751,887.06
期末基金份额净值	1.1204	1.1043
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	12.04%	10.43%

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

富荣福康混合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	-1.42%	1.11%	0.99%	0.60%	-2.41%	0.51%
过去三个月	0.24%	1.17%	-3.02%	0.58%	3.26%	0.59%

过去六个月	5.96%	0.99%	0.44%	0.59%	5.52%	0.40%
过去一年	0.25%	1.09%	-8.81%	0.69%	9.06%	0.40%
过去三年	23.35%	1.38%	-0.79%	0.84%	24.14%	0.54%
自基金合同生效起至今	12.04%	1.27%	11.17%	0.88%	0.87%	0.39%

富荣福康混合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	-1.42%	1.10%	0.99%	0.60%	-2.41%	0.50%
过去三个月	0.24%	1.17%	-3.02%	0.58%	3.26%	0.59%
过去六个月	5.96%	0.99%	0.44%	0.59%	5.52%	0.40%
过去一年	0.25%	1.09%	-8.81%	0.69%	9.06%	0.40%
过去三年	23.28%	1.38%	-0.79%	0.84%	24.07%	0.54%
自基金合同生效起至今	10.43%	1.27%	11.17%	0.88%	-0.74%	0.39%

注：本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×30%+沪深300指数收益率×70%。

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

富荣福康混合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

(2018年02月11日-2023年06月30日)



富荣福康混合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



注：本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各资产配置比例符合合同约定。

§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，办公地址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		

郎骋成	研究部总经理、 基金经理	2020-10-15	2023-03-08	16.5	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	2023-03-08	-	4	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。

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

依据当前的市场环境，本基金主要采取了自上而下的投资策略。我们把策略归结为：中期维度的行业比较、周期视角的价值发现。

“中期维度”代表着我们对重点覆盖行业基本面的高频跟踪，不做短期的追热，也不做漫长的等待，积极发现变化；

“行业比较”是通过景气+估值体系在行业间进行综合的横向对比--景气大致分为行业自身景气周期，宏观环境匹配度，政策催化力度，估值的核心则是安全边际；

我们力争通过对不同行业的跟踪，感知变化，在时间拐点处超配最具备性价比的行业。

“周期视角”即是通过复盘梳理行业演变，进而完成对周期向上、景气复苏空间的预判和把握；

“价值发现”即是尝试在估值层面量化行业和企业发展过程中的价值洼地，同时通过对行业发展矛盾的理解，对政策思路的领会，自上而下发掘业绩最为受益的公司。

我们力争通过对行业周期的理解，感知格局，发现具备价值回归和成长属性的个股。

2023年上半年我们通过中期维度的宏观判断和行业比较，发现消费型经济的复苏确定性最强，同时在估值角度来看性价比最高；因此我们在策略上偏向于在大消费板块寻找投资机会。通过进一步的分析，我们认为医药行业中院内诊疗恢复、基层医疗设施建设、以及一些中低端消费品率先引领经济的复苏。因此我们在2023年上半年整体重点关注了医药、食品饮料等行业，这一策略在上半年得到较好的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣福康混合A基金份额净值为1.1204元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.96%，同期业绩比较基准收益率为0.44%；截至报告期末富荣福康混合

C基金份额净值为1.1043元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.96%，同期业绩比较基准收益率为0.44%。

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2023年全年，国内经济持续复苏的势头不变，高增速向高质量转型的趋势不变；我们看好国内政策持续发力与内部基本面见底相叠加的行业，行业之间的相对收益与行业内部结构的分化将是证券市场投资的重心。希望基于对于中国经济阶段性核心矛盾的把握，超配一些符合中长期竞争优势的行业，加强对行情结构性的把握，同时，规避中期维度下风险较为突出的行业。

在重点关注的行业中，我们认为从政策松紧节奏、需求恢复、创新成果落地三个角度来看，医药行业整体的基本面当前或已经处于阶段性底部区间，仿制药业绩重回增长通道和创新药企业国内外商业化加速随后必将提振市场对医药行业的信心，我们站在中长期角度继续维持对这个重点行业的看好。

同时，我们将保持对地产数据和地产链数据以及消费端数据的紧密跟踪，做好对此类行业复苏超预期之后的策略应对。目前来看Q3我们将继续重点关注食品饮料，汽车等行业的数据。

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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；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基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份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2023年6月30日，根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期末有收益分配事项。

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 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，中国光大银行股份有限公司在富荣福康混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。

该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《富荣福康混合型证券投资基金2023年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§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：富荣福康混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,132,181.06	1,111,804.88
结算备付金		169,463.29	24,925.13
存出保证金		16,642.83	6,031.47
交易性金融资产	6.4.7.2	15,209,836.88	8,553,167.93
其中：股票投资		15,209,836.88	8,147,995.00
基金投资		-	-
债券投资		-	405,172.93
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	-	-
债权投资		-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		219,997.82	-
应收股利		-	-
应收申购款		358.25	425.64
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		16,748,480.13	9,696,355.05
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		209,591.04	-
应付赎回款		7,070.92	17,971.59
应付管理人报酬		20,109.11	12,461.90
应付托管费		2,010.91	1,246.21
应付销售服务费		112.77	60.12
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	148,123.66	22,192.22
负债合计		387,018.41	53,932.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	14,782,491.80	9,214,902.79

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	1,578,969.92	427,520.22
净资产合计		16,361,461.72	9,642,423.01
负债和净资产总计		16,748,480.13	9,696,355.05

注：报告截止日2023年6月30日，富荣福康混合型证券投资基金A类基金份额净值1.1204元，富荣福康混合型证券投资基金C类基金份额净值1.1043元，基金份额总额14,782,491.80份，其中富荣福康混合型证券投资基金A类基金份额2,329,160.69份，富荣福康混合型证券投资基金C类基金份额12,453,331.11份。

6.2 利润表

会计主体：富荣福康混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		643,484.35	-721,670.29
1.利息收入		8,311.04	2,876.16
其中：存款利息收入	6.4.7.8	8,311.04	2,695.23
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		-	180.93
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-61,766.12	-526,582.43
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-257,552.78	-560,013.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	186.14	5,560.13
资产支持证券投资		-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-	-
股利收益	6.4.7.12	195,600.52	27,870.72
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.13	684,106.38	-200,582.57
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.14	12,833.05	2,618.55
减：二、营业总支出		202,234.11	78,960.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	106,938.76	63,007.20
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,693.90	6,300.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	560.26	229.51
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		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.15	84,041.19	9,423.00
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		441,250.24	-800,630.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		441,250.24	-800,630.73
五、其他综合收益的税后 净额		-	-

六、综合收益总额		441,250.24	-800,630.73
----------	--	------------	-------------

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富荣福康混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	9,214,902.79	-	427,520.22	9,642,423.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	9,214,902.79	-	427,520.22	9,642,423.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,567,589.01	-	1,151,449.70	6,719,038.71
（一）、综合收益总额	-	-	441,250.24	441,250.24
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	5,567,589.01	-	710,199.46	6,277,788.47
其中：1.基金申购款	10,565,798.50	-	1,341,439.86	11,907,238.36

2.基金赎回款	-4,998,209.49	-	-631,240.40	-5,629,449.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	14,782,491.80	-	1,578,969.92	16,361,461.72
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	7,956,495.49	-	1,729,430.83	9,685,926.32
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	7,956,495.49	-	1,729,430.83	9,685,926.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-280,152.45	-	-897,812.59	-1,177,965.04
(一)、综合收益总额	-	-	-800,630.73	-800,630.73

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-280,152.45	-	-97,181.86	-377,334.31
其中: 1.基金申购款	1,090,140.20	-	36,745.88	1,126,886.08
2.基金赎回款	-1,370,292.65	-	-133,927.74	-1,504,220.39
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	7,676,343.04	-	831,618.24	8,507,961.28

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

富荣福康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[2017]867号文《关于准予富荣福康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2018年2月11日正式生效,首次设立募集规模为203,621,721.42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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司（以下简称“中国光大银行”）。

本基金的投资范围主要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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证，债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、地方政府债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、货币市场工具（含同业存单等）、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等）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的相关规定）。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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的50%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资占基金资产净值的0-3%。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：中证全债指数收益率×30%+沪深300指数收益率×70%。

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2023年6月30日及2022年12月31日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023年6月30日和2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(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。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）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。

（5）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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	1,132,181.06
等于：本金	1,131,913.69
加：应计利息	267.37
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	1,132,181.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,076,612.08	-	15,209,836.88	133,224.80
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	15,076,612.08	-	15,209,836.88	133,224.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末无衍生金融资产/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

本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

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 2023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	118,828.47

其中：交易所市场	118,828.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	29,295.19
合计	148,123.66

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 富荣福康混合A

金额单位：人民币元

项目 (富荣福康混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,534,263.04	2,534,263.04
本期申购	1,629,705.61	1,629,705.61
本期赎回（以“-”号填列）	-1,834,807.96	-1,834,807.96
本期末	2,329,160.69	2,329,160.69

6.4.7.6.2 富荣福康混合C

金额单位：人民币元

项目 (富荣福康混合C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,680,639.75	6,680,639.75
本期申购	8,936,092.89	8,936,092.89
本期赎回（以“-”号填列）	-3,163,401.53	-3,163,401.53
本期末	12,453,331.11	12,453,331.11

注：本期申购包含基金转入及红利再投的份额及金额；本期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 富荣福康混合A

单位：人民币元

项目 (富荣福康混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	768,843.57	-623,370.39	145,473.18
本期利润	-16,493.94	233,530.88	217,036.94
本期基金份额交易产生的变动数	-79,145.86	-2,950.29	-82,096.15
其中：基金申购款	495,406.61	-299,580.17	195,826.44
基金赎回款	-574,552.47	296,629.88	-277,922.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	673,203.77	-392,789.80	280,413.97

6.4.7.7.2 富荣福康混合C

单位：人民币元

项目 (富荣福康混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,843,727.56	-1,561,680.52	282,047.04
本期利润	-226,362.20	450,575.50	224,213.30
本期基金份额交易产生的变动数	1,643,070.71	-850,775.10	792,295.61
其中：基金申购款	2,540,928.02	-1,395,314.60	1,145,613.42
基金赎回款	-897,857.31	544,539.50	-353,317.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,260,436.07	-1,961,880.12	1,298,555.95

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	7,505.82
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	726.71

其他	78.51
合计	8,311.04

注：“其他”为保证金利息收入。

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	81,319,241.08
减：卖出股票成本总额	81,321,379.77
减：交易费用	255,414.09
买卖股票差价收入	-257,552.78

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,862.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,676.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	186.14

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	406,683.07

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	401,764.00
减：应计利息总额	6,595.07
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,676.00

6.4.7.11 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具产生的投资收益/损失。

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	195,600.52
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	195,600.52

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	684,106.38
——股票投资	682,782.38
——债券投资	1,324.00
——资产支持证券投资	-
——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	684,106.38

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	12,767.16
转换费收入	65.89
合计	12,833.05

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，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。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	746.00
审计费用	24,795.19
账户维护费	13,500.00
律师费	35,000.00
公证费	10,000.00
合计	84,041.19

6.4.7.16 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

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，本基金无需要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、登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	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

本基金于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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于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权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金于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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于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债券回购交易。

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	106,938.76	63,007.20
其中：支付销售机构的客户维护费	19,441.89	15,449.86

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,693.90	6,300.73

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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 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		
	富荣福康混合A	富荣福康混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	403.83	403.83
合计	0.00	403.83	403.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福康混合A	富荣福康混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	205.57	205.57
合计	0.00	205.57	205.57

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费。自2019年7月04日起本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.01%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{基金份额的销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

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 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

富荣福康混合A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至 2022年06月30日

报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

富荣福康混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	3,978,544.77	3,978,544.77
报告期间申购/买入总份额	3,477,656.06	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	7,456,200.83	3,978,544.77
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	59.87%	89.93%

注：1、申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额。

2、对于分类基金，比例的分母采用各自类别的总份额。

3、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

6.4.10.4.2 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未持有本基金份额。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日		2022年01月01日至2022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
中国光大	1,132,181.06	7,505.82	1,018,443.92	2,422.93

银行股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

6.4.12 期末（2023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/增发证券而持有的流通受限证券。

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的股票。

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，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，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、固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2023年06月30日，本基金未持有债券。（2022年12月31日：本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。）

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本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。

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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	405,172.93

合计	-	405,172.93
----	---	------------

注:1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债及央行票据。

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。

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。

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 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,132,181.06	-	-	-	1,132,181.06
结算备付金	169,463.29	-	-	-	169,463.29
存出保证金	16,642.83	-	-	-	16,642.83
交易性金融资产	-	-	-	15,209,836.88	15,209,836.88
应收清算款	-	-	-	219,997.82	219,997.82
应收申购款	-	-	-	358.25	358.25
资产总计	1,318,287.18	-	-	15,430,192.95	16,748,480.13
负债					
应付清算款	-	-	-	209,591.04	209,591.04
应付赎回款	-	-	-	7,070.92	7,070.92
应付管理人报酬	-	-	-	20,109.11	20,109.11
应付托管费	-	-	-	2,010.91	2,010.91
应付销售服务费	-	-	-	112.77	112.77
其他负债	-	-	-	148,123.66	148,123.66
负债总计	-	-	-	387,018.41	387,018.41
利率敏感度缺口	1,318,287.18	-	-	不适用	不适用
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,111,804.88	-	-	-	1,111,804.88
结算备付金	24,925.13	-	-	-	24,925.13
存出保证金	6,031.47	-	-	-	6,031.47
交易性金融资产	405,172.93	-	-	8,147,995.00	8,553,167.93
应收申购款	-	-	-	425.64	425.64
资产总计	1,547,934.41	-	-	8,148,420.64	9,696,355.05
负债					

应付赎回款	-	-	-	17,971.59	17,971.59
应付管理人报酬	-	-	-	12,461.90	12,461.90
应付托管费	-	-	-	1,246.21	1,246.21
应付销售服务费	-	-	-	60.12	60.12
其他负债	-	-	-	22,192.22	22,192.22
负债总计	-	-	-	53,932.04	53,932.04
利率敏感度缺口	1,547,934.41	-	-	不适用	不适用

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年06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。（2022年12月31日：本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.20%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。）

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股票和债券，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 2023年06月30日		上年度末 2022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	15,209,836.88	92.96	8,147,995.00	84.50
交易性金融资	-	-	-	-

产—基金投资				
交易性金融资产—债券投资	-	-	405,172.93	4.20
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,209,836.88	92.96	8,553,167.93	88.70

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	534,541.45	664,916.99
基金业绩比较基准下降5%	-534,541.45	-664,916.99	

注：基金业绩比较基准=中证全债指数收益率×30%+沪深300指数收益率×70%。

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**

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	15,209,836.88	8,147,995.00
第二层次	-	405,172.93
第三层次	-	-
合计	15,209,836.88	8,553,167.93

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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**

无。

(2) 其他事项

截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币16,361,461.72元，已连续超过六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。本基金管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。

(3) 财务报表的批准

本财务报表已于2023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	15,209,836.88	90.81
	其中：股票	15,209,836.88	90.81
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	1,301,644.35	7.77
8	其他各项资产	236,998.90	1.42
9	合计	16,748,480.13	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,400,230.88	75.79
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	1,521,955.00	9.30
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	562,000.00	3.43
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	725,651.00	4.44
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,209,836.88	92.96

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	300430	诚益通	53,664	885,992.64	5.42
2	600572	康恩贝	118,200	809,670.00	4.95
3	603198	迎驾贡酒	10,800	689,040.00	4.21
4	002737	葵花药业	27,500	669,350.00	4.09
5	688358	祥生医疗	11,955	609,705.00	3.73
6	002422	科伦药业	20,500	608,440.00	3.72
7	600750	江中药业	27,600	605,268.00	3.70
8	002223	鱼跃医疗	16,800	604,632.00	3.70
9	600211	西藏药业	9,700	576,180.00	3.52

10	301257	普蕊斯	10,000	562,000.00	3.43
11	000999	华润三九	9,100	552,006.00	3.37
12	688120	华海清科	2,184	550,477.20	3.36
13	002727	一心堂	20,800	549,120.00	3.36
14	603719	良品铺子	21,500	537,715.00	3.29
15	600332	白云山	14,400	459,072.00	2.81
16	688677	海泰新光	7,680	435,763.20	2.66
17	600511	国药股份	11,200	435,120.00	2.66
18	603222	济民医疗	41,700	434,931.00	2.66
19	603456	九洲药业	15,300	418,914.00	2.56
20	000625	长安汽车	31,500	407,295.00	2.49
21	688658	悦康药业	19,364	402,964.84	2.46
22	603882	金域医学	5,300	400,150.00	2.45
23	002965	祥鑫科技	7,100	395,328.00	2.42
24	002845	同兴达	22,600	360,470.00	2.20
25	600600	青岛啤酒	3,400	352,342.00	2.15
26	002920	德赛西威	2,200	342,782.00	2.10
27	600276	恒瑞医药	7,100	340,090.00	2.08
28	688409	富创精密	3,003	327,327.00	2.00
29	300244	迪安诊断	12,700	325,501.00	1.99
30	601567	三星医疗	25,700	324,591.00	1.98
31	605186	健麾信息	4,800	237,600.00	1.45

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	688981	中芯国际	1,875,796.42	19.45
2	688613	奥精医疗	1,798,666.82	18.65
3	603259	药明康德	1,617,664.56	16.78

4	603368	柳药集团	1,614,013.00	16.74
5	600332	白云山	1,539,503.00	15.97
6	301257	普蕊斯	1,532,720.00	15.90
7	002020	京新药业	1,296,050.00	13.44
8	002223	鱼跃医疗	1,292,714.18	13.41
9	603198	迎驾贡酒	1,281,563.00	13.29
10	300049	福瑞股份	1,263,012.00	13.10
11	688658	悦康药业	1,255,251.85	13.02
12	002019	亿帆医药	1,215,045.00	12.60
13	300430	诚益通	1,118,862.80	11.60
14	002965	祥鑫科技	1,109,552.00	11.51
15	603882	金城医学	1,079,006.00	11.19
16	600750	江中药业	1,076,015.00	11.16
17	600211	西藏药业	1,068,729.00	11.08
18	688110	东芯股份	1,042,605.71	10.81
19	688506	百利天恒	1,039,601.00	10.78
20	000538	云南白药	1,034,101.00	10.72
21	600511	国药股份	1,019,369.00	10.57
22	002727	一心堂	1,010,016.00	10.47
23	603222	济民医疗	1,002,444.00	10.40
24	002466	天齐锂业	981,021.00	10.17
25	300244	迪安诊断	972,439.00	10.09
26	688358	祥生医疗	946,286.72	9.81
27	600572	康恩贝	939,266.00	9.74
28	600993	马应龙	933,051.00	9.68
29	603108	润达医疗	930,529.00	9.65
30	688072	拓荆科技	922,097.08	9.56
31	300026	红日药业	914,805.00	9.49
32	600276	恒瑞医药	893,184.00	9.26
33	000999	华润三九	865,843.00	8.98
34	002845	同兴达	862,528.00	8.95

35	002422	科伦药业	852,839.00	8.84
36	002603	以岭药业	830,783.00	8.62
37	688687	凯因科技	793,498.37	8.23
38	002737	葵花药业	773,965.00	8.03
39	600085	同仁堂	769,077.00	7.98
40	600557	康缘药业	759,924.00	7.88
41	688012	中微公司	758,972.16	7.87
42	688677	海泰新光	745,291.58	7.73
43	605358	立昂微	738,919.00	7.66
44	605186	健麾信息	738,108.00	7.65
45	002864	盘龙药业	719,736.00	7.46
46	300705	九典制药	715,828.00	7.42
47	688082	盛美上海	704,473.91	7.31
48	603719	良品铺子	703,423.00	7.30
49	000650	仁和药业	700,356.00	7.26
50	301239	普瑞眼科	690,895.00	7.17
51	601919	中远海控	679,005.00	7.04
52	301096	百诚医药	675,645.00	7.01
53	000623	吉林敖东	670,484.00	6.95
54	300533	冰川网络	669,758.50	6.95
55	600489	中金黄金	657,869.00	6.82
56	688331	荣昌生物	651,386.45	6.76
57	300750	宁德时代	648,095.00	6.72
58	000625	长安汽车	628,885.00	6.52
59	600771	广誉远	596,574.00	6.19
60	688432	有研硅	592,672.59	6.15
61	600521	华海药业	585,058.00	6.07
62	600998	九州通	582,195.00	6.04
63	600079	人福医药	575,299.00	5.97
64	601668	中国建筑	573,635.00	5.95
65	688062	迈威生物	571,704.85	5.93

66	688120	华海清科	564,417.56	5.85
67	002675	东诚药业	559,774.00	5.81
68	603538	美诺华	518,987.00	5.38
69	601225	陕西煤业	516,963.00	5.36
70	300630	普利制药	512,574.00	5.32
71	601088	中国神华	510,993.00	5.30
72	603799	华友钴业	503,037.00	5.22
73	688389	普门科技	502,959.06	5.22
74	600535	天士力	498,431.00	5.17
75	603661	恒林股份	495,710.00	5.14
76	600600	青岛啤酒	482,446.00	5.00
77	688301	奕瑞科技	480,497.12	4.98
78	002557	洽洽食品	479,008.00	4.97
79	002275	桂林三金	478,585.00	4.96
80	688329	艾隆科技	466,246.85	4.84
81	300534	陇神戎发	447,118.00	4.64
82	688439	振华风光	446,573.21	4.63
83	603456	九洲药业	445,263.00	4.62
84	300233	金城医药	443,633.00	4.60
85	603612	索通发展	440,423.00	4.57
86	300908	仲景食品	432,256.00	4.48
87	688561	奇安信	431,935.52	4.48
88	603518	锦泓集团	429,721.00	4.46
89	603589	口子窖	425,593.00	4.41
90	688314	康拓医疗	419,678.26	4.35
91	300418	昆仑万维	417,697.00	4.33
92	002475	立讯精密	411,718.00	4.27
93	688126	沪硅产业	408,283.73	4.23
94	603099	长白山	405,560.00	4.21
95	600346	恒力石化	402,250.00	4.17
96	300358	楚天科技	399,597.00	4.14

97	300122	智飞生物	396,219.00	4.11
98	600612	老凤祥	391,152.00	4.06
99	300760	迈瑞医疗	386,568.00	4.01
100	002555	三七互娱	376,671.00	3.91
101	300404	博济医药	373,879.20	3.88
102	688668	鼎通科技	373,413.07	3.87
103	000403	派林生物	372,689.00	3.87
104	601318	中国平安	364,556.00	3.78
105	600820	隧道股份	352,562.00	3.66
106	000975	银泰黄金	346,741.00	3.60
107	600011	华能国际	343,607.00	3.56
108	600660	福耀玻璃	328,240.00	3.40
109	601567	三星医疗	327,621.00	3.40
110	300616	尚品宅配	325,830.00	3.38
111	688458	美芯晟	319,631.51	3.31
112	688409	富创精密	319,055.38	3.31
113	688139	海尔生物	318,405.72	3.30
114	002817	黄山胶囊	308,187.00	3.20
115	002920	德赛西威	304,242.00	3.16
116	301015	百洋医药	298,438.00	3.10
117	688131	皓元医药	298,331.40	3.09
118	000739	普洛药业	296,960.00	3.08
119	301111	粤万年青	296,923.70	3.08
120	688065	凯赛生物	296,499.99	3.07
121	603127	昭衍新药	294,499.00	3.05
122	000733	振华科技	280,550.00	2.91
123	300347	泰格医药	267,160.00	2.77
124	300845	捷安高科	261,739.00	2.71
125	601089	福元医药	259,559.00	2.69
126	003020	立方制药	253,088.00	2.62
127	600587	新华医疗	252,970.00	2.62

128	301089	拓新药业	251,790.00	2.61
129	301033	迈普医学	250,843.00	2.60
130	300677	英科医疗	245,245.00	2.54
131	688025	杰普特	240,977.35	2.50
132	002080	中材科技	228,698.00	2.37
133	301191	菲菱科思	221,988.00	2.30
134	688073	毕得医药	212,440.09	2.20
135	000977	浪潮信息	203,877.00	2.11
136	605507	国邦医药	194,185.00	2.01

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	688981	中芯国际	1,793,250.71	18.60
2	688613	奥精医疗	1,723,666.16	17.88
3	603368	柳药集团	1,533,814.00	15.91
4	603259	药明康德	1,507,989.00	15.64
5	002020	京新药业	1,287,414.00	13.35
6	300049	福瑞股份	1,273,464.00	13.21
7	002019	亿帆医药	1,196,867.00	12.41
8	688506	百利天恒	1,135,281.16	11.77
9	603108	润达医疗	1,065,888.00	11.05
10	600332	白云山	1,032,301.00	10.71
11	688110	东芯股份	1,020,724.04	10.59
12	000538	云南白药	1,000,666.20	10.38
13	002466	天齐锂业	974,431.00	10.11
14	688658	悦康药业	962,876.77	9.99
15	688072	拓荆科技	942,982.91	9.78
16	600993	马应龙	938,727.00	9.74

17	301257	普蕊斯	906,950.00	9.41
18	300026	红日药业	853,875.00	8.86
19	601668	中国建筑	806,212.00	8.36
20	002864	盘龙药业	800,882.00	8.31
21	688012	中微公司	789,057.90	8.18
22	688687	凯因科技	758,288.82	7.86
23	002223	鱼跃医疗	750,596.00	7.78
24	002603	以岭药业	748,161.00	7.76
25	300705	九典制药	745,923.00	7.74
26	605358	立昂微	731,284.00	7.58
27	600085	同仁堂	730,359.00	7.57
28	600489	中金黄金	711,146.00	7.38
29	600557	康缘药业	710,609.00	7.37
30	688082	盛美上海	693,542.95	7.19
31	600511	国药股份	687,158.00	7.13
32	002965	祥鑫科技	683,141.00	7.08
33	603198	迎驾贡酒	680,000.00	7.05
34	000650	仁和药业	672,121.00	6.97
35	603882	金域医学	671,954.00	6.97
36	000623	吉林敖东	671,755.00	6.97
37	601919	中远海控	660,970.00	6.85
38	300750	宁德时代	643,822.00	6.68
39	300244	迪安诊断	637,031.00	6.61
40	300533	冰川网络	634,563.00	6.58
41	688062	迈威生物	625,864.02	6.49
42	600998	九州通	609,522.00	6.32
43	301096	百诚医药	605,116.00	6.28
44	600521	华海药业	589,422.00	6.11
45	688331	荣昌生物	589,188.48	6.11
46	605186	健麾信息	576,410.00	5.98
47	600771	广誉远	575,013.00	5.96

48	603222	济民医疗	567,743.40	5.89
49	688668	鼎通科技	552,265.74	5.73
50	688432	有研硅	546,738.71	5.67
51	600211	西藏药业	545,730.00	5.66
52	600079	人福医药	545,310.00	5.66
53	301239	普瑞眼科	542,719.00	5.63
54	600750	江中药业	532,486.00	5.52
55	600276	恒瑞医药	528,086.00	5.48
56	002675	东诚药业	520,715.00	5.40
57	688301	奕瑞科技	519,359.61	5.39
58	002845	同兴达	505,545.00	5.24
59	601225	陕西煤业	502,892.00	5.22
60	002648	卫星化学	501,718.40	5.20
61	300418	昆仑万维	495,787.00	5.14
62	603538	美诺华	495,630.00	5.14
63	601088	中国神华	492,472.00	5.11
64	603799	华友钴业	490,356.68	5.09
65	688358	祥生医疗	487,899.52	5.06
66	603661	恒林股份	486,482.00	5.05
67	002275	桂林三金	486,415.00	5.04
68	600535	天士力	485,531.00	5.04
69	300630	普利制药	479,902.00	4.98
70	002557	洽洽食品	477,150.00	4.95
71	300908	仲景食品	465,920.00	4.83
72	300534	陇神戎发	460,335.00	4.77
73	600863	内蒙华电	460,030.00	4.77
74	688389	普门科技	455,159.78	4.72
75	688329	艾隆科技	450,225.40	4.67
76	300623	捷捷微电	433,745.00	4.50
77	603612	索通发展	432,864.00	4.49
78	002555	三七互娱	427,998.00	4.44

79	688439	振华风光	423,065.76	4.39
80	688126	沪硅产业	421,319.08	4.37
81	688314	康拓医疗	419,593.95	4.35
82	002727	一心堂	416,495.00	4.32
83	300358	楚天科技	414,646.00	4.30
84	688561	奇安信	411,263.41	4.27
85	603589	口子窖	411,053.00	4.26
86	002475	立讯精密	410,670.00	4.26
87	300233	金城医药	403,649.00	4.19
88	603518	锦泓集团	401,568.00	4.16
89	603099	长白山	399,100.00	4.14
90	600346	恒力石化	388,601.00	4.03
91	600612	老凤祥	381,480.00	3.96
92	000403	派林生物	375,146.00	3.89
93	002984	森麒麟	370,960.00	3.85
94	600048	保利发展	370,476.00	3.84
95	300430	诚益通	365,952.00	3.80
96	300122	智飞生物	364,002.00	3.78
97	601318	中国平安	363,073.00	3.77
98	000999	华润三九	362,265.00	3.76
99	300760	迈瑞医疗	360,381.00	3.74
100	600820	隧道股份	356,636.00	3.70
101	600011	华能国际	351,560.00	3.65
102	300404	博济医药	346,764.00	3.60
103	600660	福耀玻璃	346,517.00	3.59
104	688458	美芯晟	346,349.84	3.59
105	603112	华翔股份	345,999.00	3.59
106	605339	南侨食品	343,650.00	3.56
107	603808	歌力思	341,147.00	3.54
108	002493	荣盛石化	339,444.00	3.52
109	000975	银泰黄金	337,200.00	3.50

110	601117	中国化学	336,768.00	3.49
111	300951	博硕科技	336,186.00	3.49
112	601126	四方股份	332,576.00	3.45
113	600483	福能股份	331,914.00	3.44
114	002056	横店东磁	331,269.00	3.44
115	605399	晨光新材	330,753.00	3.43
116	300873	海晨股份	329,425.00	3.42
117	000400	许继电气	328,921.00	3.41
118	300696	爱乐达	328,070.00	3.40
119	002459	晶澳科技	317,355.00	3.29
120	603886	元祖股份	316,084.00	3.28
121	688025	杰普特	316,042.65	3.28
122	688139	海尔生物	315,191.49	3.27
123	601012	隆基绿能	314,432.00	3.26
124	300384	三联虹普	310,956.00	3.22
125	300616	尚品宅配	310,110.00	3.22
126	300887	谱尼测试	309,476.00	3.21
127	600905	三峡能源	306,714.00	3.18
128	301015	百洋医药	304,818.00	3.16
129	301111	粤万年青	299,507.00	3.11
130	002817	黄山胶囊	292,465.00	3.03
131	000739	普洛药业	289,889.00	3.01
132	688131	皓元医药	287,254.30	2.98
133	002422	科伦药业	282,707.00	2.93
134	000733	振华科技	280,820.00	2.91
135	688677	海泰新光	271,643.87	2.82
136	688065	凯赛生物	269,344.51	2.79
137	301033	迈普医学	269,240.00	2.79
138	601089	福元医药	257,884.00	2.67
139	603127	昭衍新药	252,377.00	2.62
140	003020	立方制药	250,297.00	2.60

141	300845	捷安高科	248,698.00	2.58
142	600587	新华医疗	247,983.00	2.57
143	300347	泰格医药	245,112.00	2.54
144	000625	长安汽车	243,377.00	2.52
145	300677	英科医疗	240,175.00	2.49
146	301089	拓新药业	239,100.00	2.48
147	603155	新亚强	234,520.00	2.43
148	002080	中材科技	223,938.00	2.32
149	688073	毕得医药	220,374.76	2.29
150	000977	浪潮信息	213,538.00	2.21
151	603809	豪能股份	207,725.00	2.15
152	301191	菲菱科思	197,294.30	2.05

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	87,700,439.27
卖出股票收入（成交）总额	81,319,241.08

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，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，鱼跃医疗在报告编制日前一年内因未依法履行其他职责被镇江市市场监督管理局处罚。

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	16,642.83
2	应收清算款	219,997.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	358.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	236,998.90

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未存在流通受限情况。

§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
富荣福康混合A	515	4,522.64	0.00	0.00%	2,329,160.69	100.00%
富荣福康混合C	1,229	10,132.90	11,062,444.62	88.8312%	1,390,886.49	11.1688%
合计	1,673	8,835.92	11,062,444.62	74.8348%	3,720,047.18	25.1652%

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	富荣福康混合A	41,695.58	1.79%
	富荣福康混合C	5,390.85	0.04%
	合计	47,086.43	0.32%

注：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）。

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	富荣福康混合A	0~10
	富荣福康混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	富荣福康混合A	0~10
	富荣福康混合C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣福康混合A	富荣福康混合C
基金合同生效日(2018年02月11日)基金份额总额	-	-
本报告期期初基金份额总额	2,534,263.04	6,680,639.75
本报告期基金总申购份额	1,629,705.61	8,936,092.89
减：本报告期基金总赎回份额	1,834,807.96	3,163,401.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,329,160.69	12,453,331.11

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

基金管理人以通讯方式组织召开了富荣福康混合型证券投资基金基金份额持有人大会，会议投票时间自2023年4月18日起，至2023年5月16日17:00止，并于2023年5月17日审议通过了《关于富荣福康混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》，本基金

持续运作，运作方式不发生改变，并继续现有投资策略，推进平稳运作。上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

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

本基金管理人公告：董事长杨小舟自2023年2月1日起代行首席信息官职务，董事长杨小舟自2023年2月13日起转任总经理，王亦伟自2023年4月6日起担任董事长职务，总经理杨小舟自2023年6月13日起代行督察长职务，总经理杨小舟自2023年6月14日起兼任首席信息官，史克新自2023年6月16日起担任副总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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	交易单元数量	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	
华创证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

中国国际金融	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	169,019,680.35	100.00%	160,790.87	100.00%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：（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。（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。

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
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	400,088.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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2022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	2023-01-20
2	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-03
3	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15

4	富荣福康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	2023-03-10
5	富荣福康混合型证券投资基金招募说明书更新及产品资料概要更新的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
6	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增华宝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	2023-03-15
7	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022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	2023-03-31
8	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-07
9	富荣基金管理有限公司住所变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-12
10	关于以通讯方式召开富荣福康混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-13
11	关于以通讯方式召开富荣福康混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-14
12	关于以通讯方式召开富荣福康混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15

13	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023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	2023-04-24
14	富荣福康混合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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18
15	富荣基金管理有限公司关于总经理代为履行督察长职务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
16	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
17	富荣基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-17
18	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）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	2023-06-29

§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	20230101 - 20230630	3,978,544.77	3,477,656.06	0.00	7,456,200.83	50.44%
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</p>							

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 10 个工作日内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基金合同等，并 6 个月内召开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。

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

本基金管理人公告：

1、公司住所变更为广东省广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房，上述变动已完成工商变更登记。

2、公司法定代表人变更为王亦伟，上述变动已完成工商变更登记。

§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康混合型证券投资基金设立的文件；

12.1.2 《富荣福康混合型证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《富荣福康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 报告期内富荣福康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
二〇二三年八月三十一日