

富荣福康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:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行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.....	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遵规守信情况声明.....	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.....	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.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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	57
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	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	10,923,378.95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	1,952,440.78份	8,970,938.17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	任晓伟	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	吴利军	

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)	
	富荣福康混合A	富荣福康混合C
本期已实现收益	-239,364.49	-1,275,486.09
本期利润	-354,257.80	-1,741,278.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1736	-0.1581

本期加权平均净值利润率	-19.99%	-18.42%
本期基金份额净值增长率	-16.52%	-16.53%
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	-419,594.23	-2,029,987.50
期末可供分配基金份额利润	-0.2149	-0.2263
期末基金资产净值	1,532,846.55	6,940,950.67
期末基金份额净值	0.7851	0.7737
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	-21.49%	-22.63%

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	-9.75%	1.22%	-2.03%	0.33%	-7.72%	0.89%
过去三个月	-14.99%	1.49%	-0.90%	0.52%	-14.09%	0.97%
过去六个月	-16.52%	1.92%	2.01%	0.62%	-18.53%	1.30%
过去一年	-29.93%	1.53%	-5.05%	0.61%	-24.88%	0.92%
过去三年	-26.23%	1.38%	-20.67%	0.73%	-5.56%	0.65%
自基金合同生效起至今	-21.49%	1.32%	5.55%	0.84%	-27.04%	0.48%

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	-9.75%	1.22%	-2.03%	0.33%	-7.72%	0.89%
过去三个月	-14.99%	1.49%	-0.90%	0.52%	-14.09%	0.97%
过去六个月	-16.53%	1.92%	2.01%	0.62%	-18.54%	1.30%
过去一年	-29.94%	1.53%	-5.05%	0.61%	-24.89%	0.92%
过去三年	-26.24%	1.38%	-20.67%	0.73%	-5.57%	0.65%
自基金合同 生效起至今	-22.63%	1.32%	5.55%	0.84%	-28.18%	0.48%

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-2024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



§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		

李天翔	基金经理	2023-03-08	-	5	硕士研究生，持有基金从业资格资格证书，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

2024年上半年，市场整体表现较弱，尤其是进入到5月中旬以后，回调明显。从各类风格指数的跟踪情况来看，只有红利指数，富时A50指数表现相对较好，反映出市场对于风险偏好的全面降低。

我们在产品中一直以来坚持的投资策略在二季度表现依旧不佳。医药行业中CXO板块等风险性事件依旧让市场对整体的医药行业保持了观望的态度；而我们在医药行业中选配的一些具备成长属性的中小公司也受到了市场对市值因子极度偏离的影响。

通过深入复盘，我们认为市场由于风格偏离带来的成长折价终将被纠偏。避免情绪溢价和短期基本面溢价，在超跌的版块中坚守价值，是下半年我们的策略核心。行业配置层面，通过横向比较，我们认为上游周期品价格超预期的情况在下半年难以为继，海内外需求持续走弱的情况下企业利润难以保持。同样，制造业层面，受益于海外经济基本面阶段性走强带动的出口持续性也难以为继。我们认为国内政策的发力点还是在消费上，其中，生物医药行业当前处在政策完全落地的新起点上，无论是中期的成长性还是安全边际都值得超配。

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0.7851元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.52%，同期业绩比较基准收益率为2.01%；截至报告期末富荣福康混合C基金份额净值为0.7737元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.53%，同期业绩比较基准收益率为2.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们继续保持对市场风格极致演绎的敬畏，站在基本面选行业和选股的角度，坚守理性和价值。宏观经济层面，我们认为美国正逐步走向经济的软着陆，高企的融资成本拖累下，降息近在咫尺；国内出口数据难以为继，整体的逆周期调节需要持续发力，整体环境偏宽松但信心仍不足。市场层面，上半年风格演绎较为极致，当前缺乏主线，我们认为风格上仍偏向于防守。行业配置层面，我们依然看好中期成长较为确定，价值与成长共存的医药和食品饮料等行业，继续精挑细选，以需求，政策，创新多重维度定位行业基本面和公司基本面。

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,本报告期末未有收益分配事项。

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合规守信、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2024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：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	531,091.71	669,542.65
结算备付金		162,674.45	197,791.79
存出保证金		20,621.73	19,659.72
交易性金融资产	6.4.7.2	7,893,019.64	10,632,407.79

其中：股票投资		7,690,568.96	10,632,407.79
基金投资		-	-
债券投资		202,450.68	-
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	-	-
应收清算款		477,361.07	124,336.90
应收股利		-	-
应收申购款		3,218.00	671.85
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		9,087,986.60	11,644,410.70
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		460,217.53	86,861.26
应付赎回款		33,407.73	23,597.66
应付管理人报酬		8,999.45	13,252.31
应付托管费		1,124.96	1,656.55
应付销售服务费		61.73	92.27
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	110,377.98	142,059.86
负债合计		614,189.38	267,519.91
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	10,923,378.95	12,240,824.29
未分配利润	6.4.7.7	-2,449,581.73	-863,933.50
净资产合计		8,473,797.22	11,376,890.79
负债和净资产总计		9,087,986.60	11,644,410.70

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额10,923,378.95份，其中，下属A类基金份额净值0.7851元，基金份额总额1,952,440.78份；下属C类基金份额净值0.7737元，基金份额总额8,970,938.17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：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		-1,974,597.02	643,484.35
1.利息收入		4,266.27	8,311.04
其中：存款利息收入	6.4.7.8	4,266.27	8,311.04
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,411,798.74	-61,766.12
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-1,469,320.87	-257,552.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	552.32	186.14
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	56,969.81	195,600.52
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	-580,685.26	684,106.38
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	13,620.71	12,833.05
减：二、营业总支出		120,938.82	202,234.11
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	66,904.24	106,938.76
2.托管费	6.4.10.2.2	8,363.10	10,693.90
3.销售服务费	6.4.10.2.3	469.67	560.26
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	6.4.7.15	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.16	45,201.81	84,041.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,095,535.84	441,250.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,095,535.84	441,250.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,095,535.84	441,250.24

6.3 净资产变动表

会计主体：富荣福康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	12,240,824.29	-863,933.50	11,376,890.79
二、本期期初净资产	12,240,824.29	-863,933.50	11,376,890.79
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,317,445.34	-1,585,648.23	-2,903,093.57
(一)、综合收益总额	-	-2,095,535.84	-2,095,535.84
(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)	-1,317,445.34	509,887.61	-807,557.73
其中: 1.基金申购款	9,727,909.89	-922,308.30	8,805,601.59
2.基金赎回款	-11,045,355.23	1,432,195.91	-9,613,159.32
(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	10,923,378.95	-2,449,581.73	8,473,797.22
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	9,214,902.79	427,520.22	9,642,423.01
二、本期期初净资产	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 交易产生的净资产变 动数(净资产减少以 “-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	14,782,491.80	1,578,969.92	16,361,461.72

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2024年6月30日及2023年12月31日的财务状况以及自2024年1月1日起至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

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	531,091.71
等于：本金	531,005.42
加：应计利息	86.29
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	531,091.71

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	8,144,580.58	-	7,690,568.96	-454,011.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,390.68	202,450.68	-90.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,390.68	202,450.68	-90.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,345,730.58	1,390.68	7,893,019.64	-454,101.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金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	110,377.98	
其中：交易所市场	110,377.98	
银行间市场	-	
应付利息	-	
合计	110,377.98	

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 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	2,244,509.61	2,244,509.61
本期申购	168,064.34	168,064.34
本期赎回（以“-”号填列）	-460,133.17	-460,133.17
本期末	1,952,440.78	1,952,440.78

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 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	9,996,314.68	9,996,314.68
本期申购	9,559,845.55	9,559,845.55
本期赎回（以“-”号填列）	-10,585,222.06	-10,585,222.06

本期末	8,970,938.17	8,970,938.17
-----	--------------	--------------

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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
上年度末	236,672.64	-370,208.87	-133,536.23
本期期初	236,672.64	-370,208.87	-133,536.23
本期利润	-239,364.49	-114,893.31	-354,257.80
本期基金份额交易产生的变动数	552.88	67,646.92	68,199.80
其中：基金申购款	5,683.13	-19,284.81	-13,601.68
基金赎回款	-5,130.25	86,931.73	81,801.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,138.97	-417,455.26	-419,594.23

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
上年度末	807,961.16	-1,538,358.43	-730,397.27
本期期初	807,961.16	-1,538,358.43	-730,397.27
本期利润	-1,275,486.09	-465,791.95	-1,741,278.04
本期基金份额交易产生的变动数	250,170.88	191,516.93	441,687.81
其中：基金申购款	137,164.54	-1,045,871.16	-908,706.62
基金赎回款	113,006.34	1,237,388.09	1,350,394.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-217,354.05	-1,812,633.45	-2,029,987.50

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	2,638.14
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	1,464.72
其他	163.41
合计	4,266.27

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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	128,605,427.35
减：卖出股票成本总额	129,797,928.92
减：交易费用	276,819.30
买卖股票差价收入	-1,469,320.87

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 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	2,596.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,044.01
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	552.32
----	--------

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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	610,042.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	602,812.01
减：应计利息总额	9,274.41
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,044.01

6.4.7.11 衍生工具收益

本基金本报告期末未持有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 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	56,969.81
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	56,969.81

6.4.7.13 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	-580,685.26
——股票投资	-580,595.26
——债券投资	-90.00
——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	-580,685.26

6.4.7.14 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	13,525.89
转换费收入	94.82
合计	13,620.71

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 信用减值损失

本基金本报告期内均无信用减值损失。

6.4.7.16 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	-

信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	701.81
账户维护费	4,500.00
律师费	30,000.00
公证费	10,000.00
合计	45,201.81

注:本基金自2024年5月14日起,基金运作中的固定费用由基金管理人承担,包括银行间账户维护费、审计费、信息披露费等发生的费用,2024年1月1日至2024年5月13日产生的费用仍由本基金财产承担。

6.4.7.17 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内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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	66,904.24	106,938.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,623.26	19,441.89
应支付基金管理人的净管理费	53,280.98	87,496.87

注：（1）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1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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

（2）本基金自2023年8月24日起，基金管理费的年费率由1.50%调整为1.20%

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	8,363.10	10,693.90

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的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		
	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	286.55	286.55
合计	0.00	286.55	286.55
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

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，C类基金份额的销售服务费年费率为0.01%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.01\% / \text{当年天数}$$

H为每日C类基金份额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**

富荣福康混合C

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	5,256,200.83	3,978,544.77
报告期间申购/买入总份额	-	3,477,656.06
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,256,200.83	7,456,200.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	58.59%	59.87%

注：1、对于分类基金，比例的分母采用各自类别的总份额。

2、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。

3、申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额。

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
中国光大银行股份有限公司	531,091.71	2,638.14	1,132,181.06	7,505.82

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。

6.4.10.7 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

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

本基金于本报告期内无利润分配。

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。

6.4.12.4 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证券出借业务的证券。

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、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及资产支持证券。（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。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	202,450.68	-
合计	202,450.68	-

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	531,091.71	-	-	-	531,091.71
结算备付金	162,674.45	-	-	-	162,674.45
存出保证金	20,621.73	-	-	-	20,621.73
交易性金融资产	202,450.68	-	-	7,690,568.96	7,893,019.64
应收清算款	-	-	-	477,361.07	477,361.07
应收申购款	-	-	-	3,218.00	3,218.00
资产总计	916,838.57	-	-	8,171,148.03	9,087,986.60
负债					
应付清算款	-	-	-	460,217.53	460,217.53
应付赎回款	-	-	-	33,407.73	33,407.73
应付管理人报酬	-	-	-	8,999.45	8,999.45
应付托管费	-	-	-	1,124.96	1,124.96
应付销售服务费	-	-	-	61.73	61.73
其他负债	-	-	-	110,377.98	110,377.98

负债总计	-	-	-	614,189.38	614,189.38
利率敏感度缺口	916,838.57	-	-	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	669,542.65	-	-	-	669,542.65
结算备付金	197,791.79	-	-	-	197,791.79
存出保证金	19,659.72	-	-	-	19,659.72
交易性金融资产	-	-	-	10,632,407.79	10,632,407.79
应收清算款	-	-	-	124,336.90	124,336.90
应收申购款	-	-	-	671.85	671.85
资产总计	886,994.16	-	-	10,757,416.54	11,644,410.70
负债					
应付清算款	-	-	-	86,861.26	86,861.26
应付赎回款	-	-	-	23,597.66	23,597.66
应付管理人报酬	-	-	-	13,252.31	13,252.31
应付托管费	-	-	-	1,656.55	1,656.55
应付销售服务费	-	-	-	92.27	92.27
其他负债	-	-	-	142,059.86	142,059.86
负债总计	-	-	-	267,519.91	267,519.91
利率敏感度缺口	886,994.16	-	-	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，本基金持有的交易性债券投资市值占基金资产净值的2.39%（2023年12月31日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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	7,690,568.96	90.76	10,632,407.79	93.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	202,450.68	2.39	-	-
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	7,893,019.64	93.15	10,632,407.79	93.46

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%	871,975.45	466,547.21
	基金业绩比较基准下降5%	-871,975.45	-466,547.21

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

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	7,690,568.96	10,632,407.79
第二层次	202,450.68	-
第三层次	-	-
合计	7,893,019.64	10,632,407.79

6.4.14.2.2 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	7,690,568.96	84.62
	其中：股票	7,690,568.96	84.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	202,450.68	2.23
	其中：债券	202,450.68	2.23
	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	693,766.16	7.63
8	其他各项资产	501,200.80	5.51
9	合计	9,087,986.60	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	6,840,892.96	80.73
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	525,525.00	6.20
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	285,201.00	3.37
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	-	-
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	38,950.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	7,690,568.96	90.76

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	42,400	639,392.00	7.55
2	688358	祥生医疗	22,552	585,675.44	6.91
3	601607	上海医药	27,500	525,525.00	6.20
4	688687	凯因科技	16,871	430,379.21	5.08
5	002019	亿帆医药	34,700	428,892.00	5.06

6	301033	迈普医学	10,000	391,100.00	4.62
7	605116	奥锐特	15,200	380,456.00	4.49
8	301122	采纳股份	19,430	365,866.90	4.32
9	603309	维力医疗	33,000	363,330.00	4.29
10	000403	派林生物	13,200	351,912.00	4.15
11	603198	迎驾贡酒	6,000	345,000.00	4.07
12	601633	长城汽车	13,100	331,430.00	3.91
13	300396	迪瑞医疗	15,100	306,681.00	3.62
14	301236	软通动力	8,100	285,201.00	3.37
15	600761	安徽合力	12,300	266,172.00	3.14
16	688799	华纳药厂	5,983	253,858.69	3.00
17	688581	安杰思	5,004	244,845.72	2.89
18	300529	健帆生物	7,600	206,796.00	2.44
19	300003	乐普医疗	13,900	206,276.00	2.43
20	600566	济川药业	5,500	174,405.00	2.06
21	600789	鲁抗医药	24,000	168,000.00	1.98
22	301393	昊帆生物	3,500	148,645.00	1.75
23	300406	九强生物	8,200	126,116.00	1.49
24	301149	隆华新材	13,600	125,664.00	1.48
25	301052	果麦文化	1,900	38,950.00	0.46

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	603259	药明康德	2,598,441.00	22.84
2	688166	博瑞医药	2,302,027.02	20.23
3	301236	软通动力	2,075,175.00	18.24
4	688443	智翔金泰	2,018,604.27	17.74

5	688566	吉贝尔	1,663,003.66	14.62
6	300347	泰格医药	1,625,998.00	14.29
7	002422	科伦药业	1,624,441.00	14.28
8	000426	兴业银锡	1,556,640.00	13.68
9	688687	凯因科技	1,553,226.83	13.65
10	300430	诚益通	1,541,970.00	13.55
11	300890	翔丰华	1,519,081.00	13.35
12	300719	安达维尔	1,511,604.00	13.29
13	600085	同仁堂	1,471,424.00	12.93
14	301230	泓博医药	1,423,801.00	12.51
15	002773	康弘药业	1,399,882.00	12.30
16	002428	云南锗业	1,318,262.00	11.59
17	301149	隆华新材	1,278,019.00	11.23
18	688581	安杰思	1,276,868.16	11.22
19	301033	迈普医学	1,262,005.00	11.09
20	688196	卓越新能	1,246,578.24	10.96
21	603676	卫信康	1,221,905.00	10.74
22	688266	泽璟制药	1,212,705.92	10.66
23	688358	祥生医疗	1,198,811.53	10.54
24	002019	亿帆医药	1,183,138.00	10.40
25	300233	金城医药	1,181,536.00	10.39
26	300396	迪瑞医疗	1,161,971.00	10.21
27	688506	百利天恒	1,099,577.85	9.67
28	301459	丰茂股份	1,092,053.00	9.60
29	300529	健帆生物	1,076,368.00	9.46
30	688799	华纳药厂	1,074,744.67	9.45
31	002226	江南化工	1,071,305.00	9.42
32	688197	首药控股	1,067,248.45	9.38
33	688253	英诺特	1,061,219.03	9.33
34	300457	赢合科技	1,047,633.00	9.21
35	601677	明泰铝业	1,016,395.00	8.93

36	688139	海尔生物	1,004,409.98	8.83
37	002044	美年健康	1,004,044.00	8.83
38	301096	百诚医药	990,519.00	8.71
39	605507	国邦医药	967,893.44	8.51
40	688177	百奥泰	967,871.09	8.51
41	688235	百济神州	964,805.74	8.48
42	002299	圣农发展	963,564.00	8.47
43	301257	普蕊斯	941,669.00	8.28
44	300049	福瑞股份	932,724.00	8.20
45	688621	阳光诺和	884,212.94	7.77
46	688059	华锐精密	880,100.47	7.74
47	603198	迎驾贡酒	845,817.00	7.43
48	300122	智飞生物	836,474.00	7.35
49	603067	振华股份	822,566.00	7.23
50	002597	金禾实业	815,956.00	7.17
51	300975	商络电子	808,645.00	7.11
52	688428	诺诚健华	800,298.16	7.03
53	000521	长虹美菱	774,389.00	6.81
54	688321	微芯生物	767,216.31	6.74
55	601388	怡球资源	759,331.00	6.67
56	000932	华菱钢铁	749,387.00	6.59
57	688578	艾力斯	738,285.61	6.49
58	600820	隧道股份	724,025.00	6.36
59	002991	甘源食品	719,388.00	6.32
60	600019	宝钢股份	718,105.00	6.31
61	688382	益方生物	710,947.05	6.25
62	603309	维力医疗	703,252.00	6.18
63	688131	皓元医药	683,521.83	6.01
64	600566	济川药业	662,725.00	5.83
65	688236	春立医疗	654,962.10	5.76
66	688121	卓然股份	654,647.17	5.75

67	300121	阳谷华泰	654,612.00	5.75
68	603108	润达医疗	653,399.00	5.74
69	603567	珍宝岛	646,091.00	5.68
70	600295	鄂尔多斯	635,107.80	5.58
71	002332	仙琚制药	627,895.00	5.52
72	688260	昀冢科技	612,585.79	5.38
73	300857	协创数据	593,861.00	5.22
74	605186	健麾信息	588,201.00	5.17
75	300206	理邦仪器	587,937.00	5.17
76	603477	巨星农牧	579,225.00	5.09
77	688336	三生国健	574,275.28	5.05
78	600216	浙江医药	563,594.00	4.95
79	002275	桂林三金	560,812.00	4.93
80	688390	固德威	560,040.84	4.92
81	600346	恒力石化	556,768.00	4.89
82	688192	迪哲医药	544,541.73	4.79
83	000403	派林生物	536,748.00	4.72
84	002817	黄山胶囊	535,511.00	4.71
85	300298	三诺生物	533,300.00	4.69
86	301091	深城交	529,253.00	4.65
87	603987	康德莱	516,944.00	4.54
88	601607	上海医药	514,834.00	4.53
89	688499	利元亨	506,689.30	4.45
90	603518	锦泓集团	505,324.00	4.44
91	600888	新疆众和	498,852.00	4.38
92	605266	健之佳	481,338.00	4.23
93	300677	英科医疗	478,100.00	4.20
94	300109	新开源	475,109.00	4.18
95	002567	唐人神	471,576.00	4.15
96	000425	徐工机械	469,943.00	4.13
97	603896	寿仙谷	468,008.00	4.11

98	600557	康缘药业	460,301.00	4.05
99	300763	锦浪科技	438,580.00	3.86
100	301015	百洋医药	432,832.00	3.80
101	688180	君实生物	427,448.25	3.76
102	002869	金溢科技	426,097.00	3.75
103	603369	今世缘	420,735.00	3.70
104	300003	乐普医疗	410,490.00	3.61
105	688308	欧科亿	408,365.08	3.59
106	300981	中红医疗	408,066.00	3.59
107	603168	莎普爱思	407,153.00	3.58
108	002832	比音勒芬	405,202.00	3.56
109	600079	人福医药	398,660.50	3.50
110	603233	大参林	394,571.00	3.47
111	301413	安培龙	390,811.00	3.44
112	000923	河钢资源	377,996.00	3.32
113	002432	九安医疗	373,849.00	3.29
114	603599	广信股份	373,079.00	3.28
115	301122	采纳股份	372,195.70	3.27
116	301127	天源环保	368,661.00	3.24
117	601567	三星医疗	368,553.00	3.24
118	300683	海特生物	365,555.00	3.21
119	688108	赛诺医疗	359,711.49	3.16
120	300725	药石科技	356,649.00	3.13
121	605116	奥锐特	355,913.00	3.13
122	300896	爱美客	353,266.04	3.11
123	600057	厦门象屿	351,326.00	3.09
124	600535	天士力	347,210.00	3.05
125	000999	华润三九	344,497.00	3.03
126	301367	怡和嘉业	343,739.00	3.02
127	601766	中国中车	342,616.00	3.01
128	600761	安徽合力	341,181.00	3.00

129	688393	安必平	340,993.74	3.00
130	688472	阿特斯	340,895.23	3.00
131	601633	长城汽车	340,542.00	2.99
132	600219	南山铝业	340,376.00	2.99
133	601800	中国交建	339,681.00	2.99
134	603496	恒为科技	336,899.00	2.96
135	601618	中国中冶	335,475.00	2.95
136	688016	心脉医疗	334,954.39	2.94
137	600970	中材国际	334,504.00	2.94
138	600285	羚锐制药	330,135.00	2.90
139	002821	凯莱英	328,445.00	2.89
140	688600	皖仪科技	328,084.03	2.88
141	600531	豫光金铅	325,472.00	2.86
142	300009	安科生物	325,235.00	2.86
143	002223	鱼跃医疗	321,994.00	2.83
144	688520	神州细胞	321,769.18	2.83
145	000034	神州数码	319,868.00	2.81
146	002755	奥赛康	319,858.00	2.81
147	002172	澳洋健康	319,532.00	2.81
148	603019	中科曙光	319,200.00	2.81
149	600976	健民集团	319,171.00	2.81
150	688159	有方科技	315,653.25	2.77
151	000737	北方铜业	312,893.00	2.75
152	002170	芭田股份	312,027.00	2.74
153	002603	以岭药业	311,870.00	2.74
154	002236	大华股份	310,440.00	2.73
155	688575	亚辉龙	310,174.48	2.73
156	688073	毕得医药	309,939.78	2.72
157	300735	光弘科技	309,700.00	2.72
158	600867	通化东宝	309,688.00	2.72
159	301429	森泰股份	307,846.00	2.71

160	600129	太极集团	307,023.00	2.70
161	301528	多浦乐	304,470.00	2.68
162	002664	信质集团	302,242.00	2.66
163	600490	鹏欣资源	301,893.00	2.65
164	300246	宝莱特	297,543.00	2.62
165	603127	昭衍新药	297,284.60	2.61
166	600035	楚天高速	293,220.00	2.58
167	688626	翔宇医疗	291,861.11	2.57
168	600833	第一医药	289,287.00	2.54
169	603688	石英股份	289,099.00	2.54
170	002648	卫星化学	288,296.00	2.53
171	603612	索通发展	283,437.00	2.49
172	300019	硅宝科技	280,814.00	2.47
173	600961	株冶集团	280,656.00	2.47
174	601028	玉龙股份	275,810.00	2.42
175	603269	海鸥股份	273,436.00	2.40
176	003005	竞业达	273,083.00	2.40
177	600511	国药股份	272,495.00	2.40
178	301160	翔楼新材	271,308.00	2.38
179	600502	安徽建工	271,220.00	2.38
180	000928	中钢国际	271,145.00	2.38
181	300026	红日药业	267,586.00	2.35
182	300401	花园生物	261,784.00	2.30
183	688596	正帆科技	259,253.14	2.28
184	300286	安科瑞	255,497.00	2.25
185	603882	金域医学	251,040.00	2.21
186	300161	华中数控	245,427.00	2.16
187	300760	迈瑞医疗	245,089.00	2.15
188	600428	中远海特	243,372.00	2.14
189	603667	五洲新春	241,272.00	2.12
190	300243	瑞丰高材	230,888.00	2.03

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	688443	智翔金泰	2,506,418.78	22.03
2	603259	药明康德	2,421,559.00	21.28
3	688166	博瑞医药	2,364,182.59	20.78
4	301236	软通动力	2,346,886.00	20.63
5	002422	科伦药业	2,062,982.29	18.13
6	002773	康弘药业	1,815,897.00	15.96
7	300430	诚益通	1,739,426.60	15.29
8	688566	吉贝尔	1,715,627.05	15.08
9	301230	泓博医药	1,682,262.00	14.79
10	688266	泽璟制药	1,664,043.20	14.63
11	301096	百诚医药	1,608,415.00	14.14
12	000426	兴业银锡	1,573,311.00	13.83
13	300347	泰格医药	1,527,907.00	13.43
14	300719	安达维尔	1,492,430.00	13.12
15	300049	福瑞股份	1,471,328.00	12.93
16	300890	翔丰华	1,454,028.00	12.78
17	600085	同仁堂	1,439,768.00	12.66
18	002019	亿帆医药	1,431,583.00	12.58
19	688235	百济神州	1,322,915.54	11.63
20	301033	迈普医学	1,311,958.00	11.53
21	301257	普蕊斯	1,266,726.00	11.13
22	002428	云南锗业	1,252,664.00	11.01
23	300233	金城医药	1,240,111.00	10.90
24	603676	卫信康	1,226,042.00	10.78

25	688196	卓越新能	1,154,710.43	10.15
26	688253	英诺特	1,144,318.57	10.06
27	301149	隆华新材	1,130,108.00	9.93
28	688506	百利天恒	1,105,299.42	9.72
29	688139	海尔生物	1,099,422.36	9.66
30	688687	凯因科技	1,095,836.04	9.63
31	301459	丰茂股份	1,053,778.93	9.26
32	002226	江南化工	1,030,780.00	9.06
33	601677	明泰铝业	1,029,903.00	9.05
34	688197	首药控股	1,015,020.16	8.92
35	002044	美年健康	1,001,242.00	8.80
36	688581	安杰思	992,441.07	8.72
37	300457	赢合科技	989,093.00	8.69
38	688428	诺诚健华	984,697.14	8.66
39	605507	国邦医药	969,302.68	8.52
40	603198	迎驾贡酒	961,115.00	8.45
41	300975	商络电子	906,504.11	7.97
42	002299	圣农发展	906,020.00	7.96
43	688177	百奥泰	903,868.71	7.94
44	300857	协创数据	896,150.00	7.88
45	688358	祥生医疗	872,621.46	7.67
46	603067	振华股份	866,636.00	7.62
47	300529	健帆生物	864,619.00	7.60
48	688059	华锐精密	845,077.71	7.43
49	002597	金禾实业	835,963.00	7.35
50	688799	华纳药厂	834,667.25	7.34
51	688180	君实生物	832,461.51	7.32
52	688621	阳光诺和	821,132.40	7.22
53	300396	迪瑞医疗	818,824.00	7.20
54	688382	益方生物	806,044.15	7.08
55	688578	艾力斯	801,401.71	7.04

56	300122	智飞生物	790,429.00	6.95
57	000521	长虹美菱	776,917.00	6.83
58	688321	微芯生物	766,102.59	6.73
59	000932	华菱钢铁	736,104.00	6.47
60	601388	怡球资源	725,622.00	6.38
61	002991	甘源食品	714,804.00	6.28
62	600019	宝钢股份	707,183.00	6.22
63	600820	隧道股份	693,661.00	6.10
64	688131	皓元医药	665,690.92	5.85
65	600295	鄂尔多斯	647,727.00	5.69
66	688236	春立医疗	644,014.37	5.66
67	605186	健麾信息	642,990.00	5.65
68	002332	仙琚制药	636,883.00	5.60
69	300121	阳谷华泰	634,982.00	5.58
70	300206	理邦仪器	619,681.00	5.45
71	600216	浙江医药	602,417.00	5.30
72	688121	卓然股份	595,979.72	5.24
73	603567	珍宝岛	592,044.00	5.20
74	688336	三生国健	586,402.82	5.15
75	300298	三诺生物	579,201.00	5.09
76	002275	桂林三金	569,622.00	5.01
77	603477	巨星农牧	564,839.00	4.96
78	688192	迪哲医药	564,132.91	4.96
79	600346	恒力石化	558,916.00	4.91
80	688260	昀冢科技	555,716.16	4.88
81	603987	康德莱	555,290.00	4.88
82	603108	润达医疗	551,837.00	4.85
83	301383	天键股份	549,499.70	4.83
84	600557	康缘药业	547,367.00	4.81
85	688390	固德威	544,051.89	4.78
86	000028	国药一致	524,335.90	4.61

87	600888	新疆众和	499,924.00	4.39
88	301091	深城交	498,636.00	4.38
89	603518	锦泓集团	492,625.00	4.33
90	000425	徐工机械	480,608.00	4.22
91	603896	寿仙谷	476,272.00	4.19
92	002817	黄山胶囊	473,750.00	4.16
93	300109	新开源	471,210.00	4.14
94	002567	唐人神	464,677.00	4.08
95	300677	英科医疗	463,742.00	4.08
96	605266	健之佳	463,381.00	4.07
97	002869	金溢科技	453,867.00	3.99
98	600566	济川药业	440,359.00	3.87
99	301015	百洋医药	426,420.00	3.75
100	300763	锦浪科技	424,057.00	3.73
101	603168	莎普爱思	408,256.00	3.59
102	603369	今世缘	407,702.00	3.58
103	002832	比音勒芬	402,736.00	3.54
104	301413	安培龙	400,677.00	3.52
105	000737	北方铜业	399,464.00	3.51
106	601567	三星医疗	394,570.00	3.47
107	688308	欧科亿	391,477.77	3.44
108	300981	中红医疗	382,501.00	3.36
109	688499	利元亨	379,903.11	3.34
110	600079	人福医药	377,586.00	3.32
111	688108	赛诺医疗	377,575.42	3.32
112	603233	大参林	366,736.00	3.22
113	300314	戴维医疗	364,799.00	3.21
114	603599	广信股份	362,281.40	3.18
115	300683	海特生物	358,996.00	3.16
116	603496	恒为科技	356,994.60	3.14
117	600285	羚锐制药	354,034.00	3.11

118	002432	九安医疗	350,979.00	3.09
119	300725	药石科技	349,707.00	3.07
120	600057	厦门象屿	349,266.00	3.07
121	688575	亚辉龙	348,163.22	3.06
122	600418	江淮汽车	347,652.00	3.06
123	000999	华润三九	346,484.00	3.05
124	000923	河钢资源	346,332.00	3.04
125	600976	健民集团	345,570.00	3.04
126	600535	天士力	341,658.00	3.00
127	300896	爱美客	341,000.00	3.00
128	600219	南山铝业	339,111.00	2.98
129	601766	中国中车	337,484.00	2.97
130	601800	中国交建	335,036.00	2.94
131	601089	福元医药	333,285.00	2.93
132	600531	豫光金铅	331,883.00	2.92
133	688626	翔宇医疗	325,467.09	2.86
134	688472	阿特斯	323,962.28	2.85
135	301367	怡和嘉业	320,194.00	2.81
136	688393	安必平	318,429.69	2.80
137	688520	神州细胞	318,342.81	2.80
138	000034	神州数码	318,108.00	2.80
139	300762	上海瀚讯	316,883.00	2.79
140	002223	鱼跃医疗	316,373.00	2.78
141	601618	中国中冶	314,560.00	2.76
142	688600	皖仪科技	312,964.38	2.75
143	603019	中科曙光	312,700.00	2.75
144	688016	心脉医疗	311,720.44	2.74
145	600867	通化东宝	309,852.00	2.72
146	300009	安科生物	309,624.00	2.72
147	002603	以岭药业	308,149.00	2.71
148	300735	光弘科技	306,618.00	2.70

149	002821	凯莱英	305,744.00	2.69
150	688159	有方科技	305,491.25	2.69
151	002236	大华股份	302,787.00	2.66
152	301127	天源环保	302,339.00	2.66
153	603309	维力医疗	302,205.00	2.66
154	002755	奥赛康	301,051.00	2.65
155	002664	信质集团	301,017.00	2.65
156	002172	澳洋健康	299,602.00	2.63
157	600970	中材国际	299,031.00	2.63
158	002170	芭田股份	298,762.00	2.63
159	301528	多浦乐	297,478.00	2.61
160	603882	金域医学	293,956.00	2.58
161	600129	太极集团	293,433.00	2.58
162	600961	株冶集团	292,513.00	2.57
163	688073	毕得医药	288,126.91	2.53
164	300246	宝莱特	288,009.00	2.53
165	603127	昭衍新药	286,384.40	2.52
166	300161	华中数控	282,500.00	2.48
167	603688	石英股份	280,237.00	2.46
168	600035	楚天高速	278,740.00	2.45
169	603667	五洲新春	275,535.00	2.42
170	002648	卫星化学	274,000.00	2.41
171	600502	安徽建工	273,280.00	2.40
172	603612	索通发展	270,881.00	2.38
173	601028	玉龙股份	268,427.00	2.36
174	688596	正帆科技	267,852.46	2.35
175	600511	国药股份	266,540.00	2.34
176	300760	迈瑞医疗	264,663.00	2.33
177	003005	竞业达	263,202.00	2.31
178	600490	鹏欣资源	263,132.00	2.31
179	300019	硅宝科技	260,402.00	2.29

180	000928	中钢国际	260,035.00	2.29
181	300026	红日药业	258,085.00	2.27
182	301160	翔楼新材	255,972.00	2.25
183	301429	森泰股份	253,749.00	2.23
184	603269	海鸥股份	246,811.60	2.17
185	300286	安科瑞	246,168.00	2.16
186	600833	第一医药	245,261.00	2.16
187	300243	瑞丰高材	243,080.00	2.14
188	600428	中远海特	239,435.00	2.10
189	300401	花园生物	234,840.00	2.06

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	127,436,685.35
卖出股票收入（成交）总额	128,605,427.35

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	202,450.68	2.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	202,450.68	2.39
----	----	------------	------

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019698	23国债05	2,000	202,450.68	2.39

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。

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	20,621.73
2	应收清算款	477,361.07
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,218.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	501,200.80

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情况。

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
富荣福康混合A	510	3,828.32	0.00	0.00%	1,952,440.78	100.00%
富荣福康混合C	1,326	6,765.41	5,258,110.55	58.6127%	3,712,827.62	41.3873%
合计	1,751	6,238.37	5,258,110.55	48.1363%	5,665,268.40	51.8637%

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	41,377.31	2.12%
	富荣福康混合C	1,041.94	0.01%
	合计	42,419.25	0.39%

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
	富荣福康混合C	0
	合计	0
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	44,615,915.86	159,005,805.56
本报告期期初基金份额总额	2,244,509.61	9,996,314.68
本报告期基金总申购份额	168,064.34	9,559,845.55
减：本报告期基金总赎回份额	460,133.17	10,585,222.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	1,952,440.78	8,970,938.17
-------------	--------------	--------------

§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2024年1月3日起，至2024年1月31日17:00止，并于2024年2月1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

本报告期内，基金管理人、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在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备
------	------	------	-----------	---

	数量	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	注
华创证券	1	122,233,929.27	47.74%	93,617.71	47.74%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金融	1	80,389,160.57	31.40%	61,570.42	31.40%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	53,419,022.86	20.86%	40,914.00	20.86%	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
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退租方正证券。（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
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融	400,157.00	39.83%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	604,573.01	60.17%	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	2024-02-02
3	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
4	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
5	富荣基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20
6	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
7	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
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	证券时报、基金管理人网站、	2024-06-17

	旗下部分基金新增销售机构、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	
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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

§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	20240101 - 20240630	5,256,200.83	-	-	5,256,200.83	48.12%
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
二〇二四年八月三十一日