

富荣沪深 300 指数增强型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26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2022年01月01日起至2022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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	富荣沪深300指数增强	
基金主代码	004788	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年01月24日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,044,351,769.82份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	004788	004789
报告期末下属分级基金的份额总额	566,357,234.72份	477,994,535.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深300指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与沪深300指数偏离风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过8.0%。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于证券投资基金中中高等风险、中高等预期收益的品种。本基金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具

	有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	---------------------------------

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	任晓伟	张燕
	联系电话	0755-84356633	0755-83199084
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-685-5600	95555
传真		0755-83230787	0755-83195201
注册地址		广州市南沙区海滨路171号南沙金融大厦11楼1101之一J20室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518038	518040
法定代表人		杨小舟	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	富荣沪深300指数 增强A	富荣沪深300指数 增强C
本期已实现收益	3,366,185.57	951,263.28
本期利润	-7,632,551.57	-56,325,373.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0165	-0.1175
本期加权平均净值利润率	-0.87%	-6.18%
本期基金份额净值增长率	-5.31%	-5.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	292,626,567.56	242,893,305.92
期末可供分配基金份额利润	0.5167	0.5082
期末基金资产净值	1,145,290,818.55	962,031,998.09
期末基金份额净值	2.0222	2.0126
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	180.71%	179.68%

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

富荣沪深300指数增强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	11.02%	1.10%	9.12%	1.02%	1.90%	0.08%
过去三个月	9.03%	1.43%	5.93%	1.36%	3.10%	0.07%
过去六个月	-5.31%	1.45%	-8.72%	1.38%	3.41%	0.07%
过去一年	-1.98%	1.29%	-13.40%	1.18%	11.42%	0.11%
过去三年	133.00%	1.32%	16.70%	1.20%	116.30%	0.12%
自基金合同 生效起至今	180.71%	1.34%	40.84%	1.25%	139.87%	0.09%

富荣沪深300指数增强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	11.00%	1.10%	9.12%	1.02%	1.88%	0.08%
过去三个月	9.00%	1.43%	5.93%	1.36%	3.07%	0.07%
过去六个月	-5.37%	1.45%	-8.72%	1.38%	3.35%	0.07%
过去一年	-2.08%	1.29%	-13.40%	1.18%	11.32%	0.11%
过去三年	132.27%	1.32%	16.70%	1.20%	115.57%	0.12%
自基金合同 生效起至今	179.68%	1.34%	40.84%	1.25%	138.84%	0.09%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

3.2.2 自基金转型以来基金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

富荣沪深300指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年01月24日-2022年06月30日)



富荣沪深300指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年01月24日-2022年06月30日)



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
邓宇翔	权益投资部总经理、基金经理	2018-11-06	-	15.5	硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任西南证券股份有限公司资深投资经理、深圳东新佳投资有限公司投资经理。2017年2月22日加入富荣基金。
郎骋成	研究部总经理、基金经理	2020-07-16	-	15.5	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。
--	--	--	--	--	------------

注：1、本基金已于2019年1月24日转型，转型后仍由邓宇翔担任基金经理。

2、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。

3、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、邓宇翔自2022年8月5日起离任本基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
郎骋成	公募基金	3	2,306,227,036.71	2020-07-16
	私募资产管理计划	2	14,136,074.91	2020-09-22
	其他组合	-	-	-
	合计	5	2,320,363,111.62	-

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

虽然流动性相对宽裕，但上半年的A股表现并不理想，所有宽基指数均告下跌。其中，上证综指下跌6.63%，上证50指数下跌6.59%，沪深300指数下跌9.22%，创业板指下跌15.41%，科创50下跌20.92%。从申万一级行业指数看，上半年仅有煤炭行业上涨，涨幅为31.38%，其他30个一级行业全部下跌，特别是TMT行业跌幅居前，电子、计算机、传媒分别下跌24.46%、23.64%、22.25%。

基于宏观模型自上而下的调整行业配置以及基于价值成长理念自下而上的配置个股是我们构建投资组合的基础。2022年上半年，Omicron引发的经济超预期下滑对投资体系造成了冲击，导致产品超额收益出现了一定幅度的回撤。3月，国内宏观数据公布之后，我们对经济的前景不再悲观，基于对产业链的研究，加大了组合中汽车零部件和光伏等板块的配置比例。但因为江浙地区受疫情波及，汽车和电新等制造环节在4-5月普遍减少开工甚至停工停产，市场对这类公司全年的业绩变的非常悲观，相关上市公司遭遇了估值和利润双杀的局面，3月中旬开始产品表现阶段性落后和重仓行业的持续杀跌密不可分。经过反复的检讨和论证，我们认为高端制造和新能源大概率将在中国经济转型持续受益，那么当疫情这种仅能对企业盈利造成季度级别利润影响的事件发生后，伴随着股价的下跌估值在中期看越来越具有吸引力。基于此，我们维持了组合仓位和结构，并在4月末市场反弹中获得了回报。随着6月PMI数据的公布，支持市场快速反弹的“经济快速恢复”预期已经得以佐证，对于疫情管控边际放松也在6月中下旬变成了市场的一致预期。在一片乐观的展望中，A股各宽基指数涨幅趋缓逐步转入震荡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣沪深300指数增强A基金份额净值为2.0222元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.31%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%；截至报告期末富荣沪深300指数增强C基金份额净值为2.0126元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.37%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年前6个月全球的宏观和经济环境是复杂多变的。年初，全球绝大多数国家开始采用“躺平”的政策应对新冠病毒，经济活动重启拉动需求出现了明显回升，原油价格在2022年的前两个月稳步上行至100美元/桶附近，为了管理通胀，美联储重回加息周期，分别在3月、5月、6月加息25、50和75个基点，递进的加息幅度充分显示出控制通胀的紧迫性。

目前来看，美联储连续加息并没有如预期般的抑制通胀。美国劳工部公布的数据显示，5月美国消费者价格指数（CPI）环比上涨1.0%，同比上涨8.6%，同比涨幅创40年来新高。我们认为，加息效果不佳和超预期演绎的俄乌冲突有关。由于俄罗斯迟迟不能宣

布结束战争，西方对其的制裁（特别是能源相关）逐步加码，供应链重塑造成的供给下降幅度远远大于货币政策收紧对需求的压制，加剧了能源相关商品的供不应求程度。这种情况下，以管理通胀为首要目标的美联储将被迫继续收紧，Vanguard预计美联储年底的利率目标区间为3%-3.25%，2023年最终利率至少为4%。

美国通胀终将被控制，但经济领先于通胀见顶可能引发海外出现新的风险。我们观察到美国6月Markit制造业PMI初值录得52.4，创23个月新低，并大幅低于前值的57。特别美国6月制造业产出指数初值由5月的55.2降至49.6，新冠疫情爆发两年来首次跌破枯荣线。根据6月公布的《全球基金经理调查报告》，32%的基金经理认为央行鹰派加息是最大的尾部风险，其次是全球经济衰退（25%），通货膨胀排在第3位。从调研结果不难看出，由于美联储在近期明确表示已准备好抑制增长的准备，资本市场逐步淡化了对通胀的关注，转向对系统性信用风险事件的担忧。

目前国内坚持动态清零的方针，但新冠Omicron变种成为影响上半年中国经济的“灰犀牛”。由于Omicron变种传染能力的大幅提升，各地的确诊病例频繁出现。3月因疫情，一定程度上影响了国内制造业。5月开始，国内的疫情防控和刺激手段都出现了一些变化。我们判断，政策的变化将引导宏观环境进入一个新的阶段，消费或将助力投资共同推动经济向年初指定的目标靠拢。

下半年还能期待什么？按我们的理解，市场对于分子端（企业利润）修复的重新定价已经基本完成，海外持续加息和国内地产恢复缓慢的背景下，很难对市场盈利预期的进一步上修报以更多期待。分子端难以继续有所突破的时候，分母端（贴现率）或将成为主导下一阶段市场走势的重要因素。在我们的宏观框架下，国内流动性自2021年三季度起开始逐步宽松，2022年上半年疫情和地产等因素的扰动，迫使中国货币政策无视海外加息继续维持流动性充裕。但这种情况可能已经演绎到了极致，7月起国内逐步抬升的CPI和同期偏低基数下的经济增速读数的逐步修复，流动性进一步宽松的概率在逐步降低。我们判断，总量宽松下流动性边际收紧有可能是未来半年最有可能出现的货币环境。历史经验看，信用宽松配合货币总量宽松边际收紧的组合下，大盘和中盘蓝筹的表现相对较好。结合着保就业稳经济的目标，我们对下半年消费行业更加乐观。

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2022年6月30日,根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：富荣沪深300指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	108,554,393.89	36,144,659.86
结算备付金		31,881,073.95	17,376,516.56
存出保证金		355,778.67	412,896.12
交易性金融资产	6.4.7.2	1,969,863,704.22	1,408,271,976.17
其中：股票投资		1,875,735,817.51	1,347,231,619.47
基金投资		-	-
债券投资		94,127,886.71	61,040,356.70
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		13,796,049.43	75,311,413.19
应收股利		-	-
应收申购款		7,883,180.30	6,127,890.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,201,695.43
资产总计		2,132,334,180.46	1,544,847,047.54
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021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		-	1,460,042.27
应付赎回款		22,380,780.68	30,239,122.85
应付管理人报酬		974,201.70	745,791.11
应付托管费		162,366.94	124,298.53
应付销售服务费		75,025.11	76,453.23
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	6.4.7.6	1,418,989.39	1,352,643.35
负债合计		25,011,363.82	33,998,351.34
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	1,044,351,769.82	709,246,217.31
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,062,971,046.82	801,602,478.89
净资产合计		2,107,322,816.64	1,510,848,696.20
负债和净资产总计		2,132,334,180.46	1,544,847,047.54

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额总额1,044,351,769.82份。A类基金份额净值人民币2.0222元，基金份额总额566,357,234.72份。C类基金份额净值人民币2.0126元，基金份额总额477,994,535.10份。

2、以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：富荣沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-57,071,002.03	75,787,652.78
1. 利息收入		473,612.00	516,143.11
其中：存款利息收入	6.4.7.9	359,973.11	410,940.71
债券利息收入		-	24.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		113,638.89	105,177.82
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,849,679.80	134,538,633.14
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,493,377.93	126,258,780.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	821,693.34	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	14,521,364.39	8,279,853.14
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）	6.4.7.14	-68,275,373.84	-61,782,986.92
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.15	881,080.01	2,515,863.45
减：二、营业总支出		6,886,922.96	9,349,222.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	5,298,267.90	3,898,677.07
2. 托管费	6.4.10.2. 2	883,044.56	649,779.50
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	451,771.45	492,080.66
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		0.28	0.11
8. 其他费用	6.4.7.16	253,838.77	4,308,685.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-63,957,924.99	66,438,430.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-63,957,924.99	66,438,430.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-63,957,924.99	66,438,430.38

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富荣沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	709,246,217.31	-	801,602,478.89	1,510,848,696.20
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）	709,246,217.31	-	801,602,478.89	1,510,848,696.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	335,105,552.51	-	261,368,567.93	596,474,120.44

(一)、综合收益总额	-	-	-63,957,924.99	-63,957,924.99
(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)	335,105,552.51	-	325,326,492.92	660,432,045.43
其中: 1. 基金申购款	717,118,899.52	-	665,930,144.83	1,383,049,044.35
2. 基金赎回款	-382,013,347.01	-	-340,603,651.91	-722,616,998.92
(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)	1,044,351,769.82	-	1,062,971,046.82	2,107,322,816.64
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021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)	355,512,857.06	-	332,000,596.27	687,513,453.33
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)	355,512,857.06	-	332,000,596.27	687,513,453.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	441,801,745.02	-	511,303,387.29	953,105,132.31
(一)、综合收益总额	-	-	66,438,430.38	66,438,430.38
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	441,801,745.02	-	444,864,956.91	886,666,701.93

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	1,082,092,033.02	-	1,098,205,500.61	2,180,297,533.63
2. 基金赎回款	-640,290,288.00	-	-653,340,543.70	-1,293,630,831.70
(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)	797,314,602.08	-	843,303,983.56	1,640,618,585.64

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

富荣沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系由富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金转型而来。富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]726号文《关于准予富荣福泰灵活配置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人募集，基金合同于2018年2月11日正式生效，首次设立募集规模为201,121,576.58份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的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，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于2018年12月24日表决通过的《富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，自2019年1月24日起变更为本基金，转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制及业绩比较基准、估值方法、基金费用、基金份额的申购赎回等相关内容按照《富荣沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。

本基金主要投资于沪深300指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（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)、货币市场工具(含同业存单等)、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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比例不低于80%,投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,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、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

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2022年6月30日及2021年12月31日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年6月30日和2021年1月1日至2021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

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额

计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币36,144,659.86元，自应收利息转入的重分类金额为人民币9,752.02元，重新计量预期

信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币36,154,411.88元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币17,376,516.56元，自应收利息转入的重分类金额为人民币4,258.23元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币17,380,774.79元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币412,896.12元，自应收利息转入的重分类金额为人民币204.38元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币413,100.50元。

买入返售金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币0.00元，自应收利息转入的重分类金额为人民币-27,590.29元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币-27,590.29元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,201,695.43元，转出至银行存款的重分类金额为人民币9,752.02元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币4,258.23元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币204.38元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币1,215,071.09元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币-27,590.29元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币61,040,356.70元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,215,071.09元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币62,255,427.79元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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	
	2022年06月30日	
活期存款	108,554,393.89	
等于：本金	108,541,658.02	
加：应计利息	12,735.87	
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	108,554,393.89	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,929,566,100.51	-	1,875,735,817.51	-53,830,283.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	92,847,603.13	1,232,442.21	94,127,886.71	47,841.37
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	92,847,603.13	1,232,442.21	94,127,886.71	47,841.37
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,022,413,703.64	1,232,442.21	1,969,863,704.22	-53,782,441.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,492.25
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,002,973.44
其中：交易所市场	1,002,973.44
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,095.94
其他应付	197,427.76
合计	1,418,989.39

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 富荣沪深300指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (富荣沪深300指数增强A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	279,362,284.65	279,362,284.65
本期申购	405,734,769.09	405,734,769.09
本期赎回(以“-”号填列)	-118,739,819.02	-118,739,819.02
本期末	566,357,234.72	566,357,234.72

6.4.7.7.2 富荣沪深300指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (富荣沪深300指数增强C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	429,883,932.66	429,883,932.66
本期申购	311,384,130.43	311,384,130.43
本期赎回(以“-”号填列)	-263,273,527.99	-263,273,527.99
本期末	477,994,535.10	477,994,535.10

注：申购包含基金转入及红利再投资的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 富荣沪深300指数增强A

单位：人民币元

项目 (富荣沪深300指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	143,301,612.04	173,966,670.16	317,268,282.20
本期利润	3,366,185.57	-10,998,737.14	-7,632,551.57
本期基金份额交易产生的变动数	145,958,769.95	123,339,083.25	269,297,853.20

其中：基金申购款	205,874,567.11	169,225,203.76	375,099,770.87
基金赎回款	-59,915,797.16	-45,886,120.51	-105,801,917.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	292,626,567.56	286,307,016.27	578,933,583.83

6.4.7.8.2 富荣沪深300指数增强C

单位：人民币元

项目 (富荣沪深300指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	217,268,794.72	267,065,401.97	484,334,196.69
本期利润	951,263.28	-57,276,636.70	-56,325,373.42
本期基金份额交易产生的变动数	24,673,247.92	31,355,391.80	56,028,639.72
其中：基金申购款	155,632,775.91	135,197,598.05	290,830,373.96
基金赎回款	-130,959,527.99	-103,842,206.25	-234,801,734.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	242,893,305.92	241,144,157.07	484,037,462.99

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	160,116.36
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	197,192.74
其他	2,664.01
合计	359,973.11

注：其他为交易保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	1,185,682,707.25
减：卖出股票成本总额	1,187,467,644.84
减：交易费用	3,708,440.34
买卖股票差价收入	-5,493,377.93

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	891,495.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-69,801.86
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	821,693.34

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	97,732,473.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	95,085,482.52
减：应计利息总额	2,716,663.85
减：交易费用	128.79

买卖债券差价收入	-69,801.86
----------	------------

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具产生的投资收益/损失。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	14,521,364.39
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	14,521,364.39

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-68,275,373.84
——股票投资	-68,328,292.62
——债券投资	52,918.78
——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	-68,275,373.84

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	880,997.60
转换费收入	82.41
合计	881,080.01

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。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,455.67
指数使用费	141,287.16
合计	253,838.77

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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期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 2022年01月01日至202	上年度可比期间 2021年01月01日至202

	2年06月30日	1年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,298,267.90	3,898,677.07
其中：支付销售机构的客户维护费	1,831,677.06	1,476,285.87

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	883,044.56	649,779.50

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0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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 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		
	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C	合计
富荣基金 管理有限 公司	0.00	77,185.86	77,185.86
招商银行 股份有限 公司	0.00	0.00	0.00

合计	-	77,185.86	77,185.86
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C	合计
富荣基金 管理有限 公司	0.00	67,629.20	67,629.20
招商银行 股份有限 公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	67,629.20	67,629.20

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。本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。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

本基金于本报告期内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

本年度及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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

招商银行 股份有限 公司	108,554,393.89	160,116.36	49,758,236.00	393,759.84
--------------------	----------------	------------	---------------	------------

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金于本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600938	中国海油	2022-04-14	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688062	迈威生物	2022-01-06	6个月	科创板打新限售	34.80	16.78	27,002	939,669.60	453,093.56	-
688234	天岳先进	2022-01-05	6个月	科创板打新限售	82.79	65.19	6,759	559,577.61	440,619.21	-
688322	奥比中光	2022-06-30	5个交易日	新股未上市	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	9个交易日	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	创业板打新限售	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	创业板打新限售	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-

301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	创业板打新限售	48.57	31.38	1,868	90,735.60	58,617.84	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	创业板打新限售	96.69	87.82	520	50,280.22	45,666.40	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	创业板打新限售	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	创业板打新限售	72.87	45.69	894	65,142.80	40,846.86	-
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	创业板打新限售	108.91	82.76	404	43,997.64	33,435.04	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	创业板打新限售	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301207	华兰疫苗	2022-02-10	6个月	创业板打新限售	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	创业板打新限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	创业板打新限售	23.20	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	创业板打新限售	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月	创业板打新限售	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	创业板打新限售	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	创业板打新限售	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月	创业板打新限售	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月	创业板打新限售	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6个月	创业板打新限售	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	创业板打新限售	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	创业板打新限售	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301239	普瑞	2022-06	6个月	创业板打	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-

	眼科	-22		新限售						
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	创业板打新限售	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	创业板打新限售	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	创业板打新限售	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	创业板打新限售	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	32.69	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	创业板打新限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月	创业板打新限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	创业板打新限售	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	创业板打新限售	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月	创业板打新限售	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	创业板打新限售	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6个月	创业板打新限售	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月	创业板打新限售	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	创业板打新限售	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	创业板打新限售	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月	创业板打新限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	创业板打新限售	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-

301237	和顺科技	2022-03-16	6个月	创业板打新限售	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	创业板打新限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	创业板打新限售	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月	创业板打新限售	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	创业板打新限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月	创业板打新限售	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6个月	创业板打新限售	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月	创业板打新限售	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	创业板打新限售	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月	创业板打新限售	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	创业板打新限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301158	德石股份	2022-01-07	6个月	创业板打新限售	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6个月	创业板打新限售	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022-04-06	6个月	创业板打新限售	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	创业板打新限售	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。本报告期间若有除权，认购价格为除权后的价格，数量为期末实际持有数量。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2022年06月30日	2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	94,127,886.71	46,995,221.20
合计	94,127,886.71	46,995,221.20

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在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据和部分短期融资券。

3. 债券投资以净价列示。

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	14,045,135.50
合计	-	14,045,135.50

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、政策性金融债以及央行票据。

3. 债券投资以净价列示。

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严格按照《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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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 2022 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	108,554,393.89	-	-	-	108,554,393.89
结算备付金	31,881,073.95	-	-	-	31,881,073.95
存出保证金	355,778.67	-	-	-	355,778.67
交易性金融资产	94,127,886.71	-	-	1,875,735,817.51	1,969,863,704.22
应收清算款	-	-	-	13,796,049.43	13,796,049.43
应收申购款	-	-	-	7,883,180.30	7,883,180.30
资产总计	234,919,133.22	-	-	1,897,415,047.24	2,132,334,180.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,380,780.68	22,380,780.68
应付管理人报酬	-	-	-	974,201.70	974,201.70
应付托管费	-	-	-	162,366.94	162,366.94
应付销售服务费	-	-	-	75,025.11	75,025.11
其他负债	-	-	-	1,418,989.39	1,418,989.39
负债总计	-	-	-	25,011,363.82	25,011,363.82
利率敏感度缺口	234,919,133.22	-	-	不适用	不适用
上上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	36,144,659.86	-	-	-	36,144,659.86
结算备付金	17,376,516.56	-	-	-	17,376,516.56
存出保证金	412,896.12	-	-	-	412,896.12
交易性金融资产	61,040,356.70	-	-	1,347,231,619.47	1,408,271,976.17
应收证券清算款	-	-	-	75,311,413.19	75,311,413.19
应收利息	-	-	-	1,201,695.43	1,201,695.43
应收申购款	-	-	-	6,127,890.21	6,127,890.21
资产总计	114,974,429.24	-	-	1,429,872,618.30	1,544,847,047.54
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,460,042.27	1,460,042.27
应付赎回款	-	-	-	30,239,122.85	30,239,122.85
应付管理人报酬	-	-	-	745,791.11	745,791.11
应付托管费	-	-	-	124,298.53	124,298.53

应付销售服务费	-	-	-	76,453.23	76,453.23
应付交易费用	-	-	-	1,069,690.02	1,069,690.02
其他负债	-	-	-	282,953.33	282,953.33
负债总计	-	-	-	33,998,351.34	33,998,351.34
利率敏感度缺口	114,974,429.24	-	-	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2022年06月30日，本基金持有交易性债券市值占资产净值的4.47%，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 2022年06月30日		上年度末 2021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	1,875,735,817.51	89.01	1,347,231,619.47	89.17
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产	94,127,886.71	4.47	61,040,356.70	4.04

一债券投资				
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	1,969,863,704.22	93.48	1,408,271,976.17	93.21

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	109,001,363.80	78,317,572.72
	基金业绩比较基准下降5%	-109,001,363.80	-78,317,572.72

注：基金业绩比较基准 = 沪深300指数收益率 × 95% + 银行活期存款利率（税后）× 5%。

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
---------------	--------------------	---------------------

第一层次	1,871,658,380.70	1,338,922,795.93
第二层次	94,868,359.95	61,420,586.05
第三层次	3,336,963.57	7,928,594.19
合计	1,969,863,704.22	1,408,271,976.17

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. 财务报表的批准

本财务报表已于2022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	1,875,735,817.51	87.97
	其中：股票	1,875,735,817.51	87.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	94,127,886.71	4.41

	其中：债券	94,127,886.71	4.41
	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	140,435,467.84	6.59
8	其他各项资产	22,035,008.40	1.03
9	合计	2,132,334,180.46	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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,239,621.00	0.58
B	采矿业	41,278,719.00	1.96
C	制造业	1,021,026,150.63	48.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,482,261.00	3.63
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	54,922,853.00	2.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,600,083.39	0.79
J	金融业	445,428,664.45	21.14
K	房地产业	32,512,266.00	1.54
L	租赁和商务服务业	78,440,285.00	3.72
M	科学研究和技术服务业	57,662,455.00	2.74
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,836,593,358.47	87.15

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,332,303.44	0.06
C	制造业	16,925,337.46	0.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,958,848.00	0.33
E	建筑业	5,675,171.00	0.27
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
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	7,892,024.44	0.37
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	53,749.33	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	54,043.74	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.01

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,142,459.04	1.86

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	51,800	105,931,000.00	5.03
2	300750	宁德时代	158,000	84,372,000.00	4.00
3	601318	中国平安	1,730,300	80,787,707.00	3.83
4	000858	五粮液	393,632	79,486,109.76	3.77
5	002142	宁波银行	1,846,600	66,126,746.00	3.14
6	000568	泸州老窖	258,800	63,804,552.00	3.03
7	601658	邮储银行	11,772,500	63,453,775.00	3.01
8	300122	智飞生物	533,900	59,268,239.00	2.81
9	000001	平安银行	3,938,200	58,994,236.00	2.80
10	603259	药明康德	554,500	57,662,455.00	2.74
11	002027	分众传媒	7,976,200	53,679,826.00	2.55
12	300760	迈瑞医疗	169,600	53,118,720.00	2.52
13	600745	闻泰科技	584,300	49,729,773.00	2.36
14	601012	隆基绿能	725,820	48,361,386.60	2.29
15	600660	福耀玻璃	1,087,867	45,483,719.27	2.16
16	601601	中国太保	1,804,500	42,459,885.00	2.01
17	601899	紫金矿业	4,424,300	41,278,719.00	1.96
18	600030	中信证券	1,893,800	41,019,708.00	1.95
19	600031	三一重工	2,146,500	40,912,290.00	1.94

20	600905	三峡能源	6,236,900	39,230,101.00	1.86
21	300059	东方财富	1,502,300	38,158,420.00	1.81
22	600011	华能国际	5,291,500	37,252,160.00	1.77
23	002493	荣盛石化	2,316,500	35,650,935.00	1.69
24	002352	顺丰控股	603,200	33,664,592.00	1.60
25	600048	保利发展	1,862,100	32,512,266.00	1.54
26	000333	美的集团	483,000	29,168,370.00	1.38
27	601377	兴业证券	4,051,089	28,560,177.45	1.36
28	600690	海尔智家	972,200	26,696,612.00	1.27
29	601166	兴业银行	1,299,900	25,868,010.00	1.23
30	601888	中国中免	106,300	24,760,459.00	1.17
31	002415	海康威视	622,700	22,541,740.00	1.07
32	600887	伊利股份	566,600	22,069,070.00	1.05
33	688036	传音控股	232,400	20,737,052.00	0.98
34	300014	亿纬锂能	199,000	19,402,500.00	0.92
35	601966	玲珑轮胎	759,900	19,278,663.00	0.91
36	002812	恩捷股份	75,900	19,009,155.00	0.90
37	002241	歌尔股份	523,000	17,572,800.00	0.83
38	000725	京东方 A	3,463,500	13,646,190.00	0.65
39	600196	复星医药	285,500	12,587,695.00	0.60
40	300498	温氏股份	574,900	12,239,621.00	0.58
41	000786	北新建材	342,600	11,860,812.00	0.56
42	600809	山西汾酒	35,200	11,432,960.00	0.54
43	300274	阳光电源	115,200	11,318,400.00	0.54
44	600009	上海机场	185,000	10,489,500.00	0.50
45	300408	三环集团	327,600	9,860,760.00	0.47
46	300782	卓胜微	71,040	9,590,400.00	0.46
47	600406	国电南瑞	338,640	9,143,280.00	0.43
48	688599	天合光能	132,100	8,619,525.00	0.41
49	600426	华鲁恒升	261,500	7,635,800.00	0.36
50	601111	中国国航	647,100	7,512,831.00	0.36

51	601728	中国电信	1,999,143	7,456,803.39	0.35
52	601865	福莱特	192,700	7,341,870.00	0.35
53	600276	恒瑞医药	182,900	6,783,761.00	0.32
54	002049	紫光国微	35,100	6,659,172.00	0.32
55	002271	东方雨虹	127,400	6,557,278.00	0.31
56	000100	TCL科技	1,324,600	6,344,834.00	0.30
57	600741	华域汽车	275,800	6,343,400.00	0.30
58	603806	福斯特	95,300	6,244,056.00	0.30
59	603260	合盛硅业	45,800	5,402,568.00	0.26
60	000338	潍柴动力	324,500	4,046,515.00	0.19
61	601021	春秋航空	55,800	3,255,930.00	0.15
62	002938	鹏鼎控股	105,800	3,196,218.00	0.15
63	000301	东方盛虹	175,000	2,959,250.00	0.14

7.3.2 期末积极投资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	600941	中国移动	120,411	7,284,865.50	0.35
2	002648	卫星化学	277,200	7,165,620.00	0.34
3	001289	龙源电力	319,800	6,958,848.00	0.33
4	601117	中国化学	603,100	5,675,171.00	0.27
5	300207	欣旺达	133,600	4,221,760.00	0.20
6	688220	翱捷科技	43,400	3,018,470.00	0.14
7	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.06
8	688234	天岳先进	13,400	885,566.21	0.04
9	688062	迈威生物	27,002	453,093.56	0.02
10	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.01
11	688325	赛微微电	4,039	247,186.80	0.01
12	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
13	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01

14	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.01
15	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
16	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
17	301236	软通动力	1,868	58,617.84	0.00
18	301219	腾远钴业	520	45,666.40	0.00
19	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
20	301206	三元生物	894	40,846.86	0.00
21	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
22	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
23	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
24	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
25	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
26	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
27	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
28	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
29	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
30	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
31	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
32	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
33	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
34	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
35	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
36	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
37	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
38	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
39	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
40	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
41	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
42	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
43	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
44	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00

45	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
46	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
47	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
48	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
49	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
50	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
51	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
52	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
53	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
54	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
55	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
56	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
57	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
58	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
59	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
60	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
61	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
62	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
63	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
64	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
65	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
66	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
67	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
68	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	67,862,635.45	4.49

2	601318	中国平安	51,238,377.48	3.39
3	601012	隆基绿能	50,654,455.00	3.35
4	600030	中信证券	49,924,116.00	3.30
5	000002	万科A	44,814,483.32	2.97
6	000858	五粮液	44,447,591.38	2.94
7	688599	天合光能	43,997,405.06	2.91
8	601688	华泰证券	41,727,004.00	2.76
9	600048	保利发展	41,153,646.00	2.72
10	600519	贵州茅台	40,174,468.12	2.66
11	600011	华能国际	35,804,048.00	2.37
12	600905	三峡能源	35,597,614.00	2.36
13	601377	兴业证券	33,645,857.93	2.23
14	300059	东方财富	33,304,429.34	2.20
15	000301	东方盛虹	33,243,898.00	2.20
16	002459	晶澳科技	32,903,738.00	2.18
17	603259	药明康德	32,711,686.00	2.17
18	000001	平安银行	30,950,977.00	2.05
19	002142	宁波银行	28,168,172.10	1.86
20	601658	邮储银行	27,439,814.00	1.82

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	000002	万科A	46,610,592.68	3.09
2	002459	晶澳科技	42,703,404.00	2.83
3	601669	中国电建	42,441,208.96	2.81
4	601688	华泰证券	41,979,559.00	2.78
5	688599	天合光能	41,420,583.78	2.74
6	603260	合盛硅业	39,417,780.12	2.61

7	000301	东方盛虹	34,893,872.36	2.31
8	002049	紫光国微	31,890,527.00	2.11
9	600196	复星医药	31,506,738.00	2.09
10	000938	紫光股份	30,839,195.94	2.04
11	600426	华鲁恒升	29,081,861.00	1.92
12	603233	大参林	25,776,607.64	1.71
13	000776	广发证券	25,436,436.00	1.68
14	300014	亿纬锂能	24,436,602.00	1.62
15	300059	东方财富	23,482,024.80	1.55
16	002493	荣盛石化	21,191,373.00	1.40
17	300450	先导智能	20,378,053.00	1.35
18	000001	平安银行	19,983,382.44	1.32
19	603501	韦尔股份	19,962,465.00	1.32
20	002821	凯莱英	19,905,886.00	1.32

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	1,784,300,135.50
卖出股票收入（成交）总额	1,185,682,707.25

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	94,127,886.71	4.47
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	94,127,886.71	4.47

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	019658	21国债10	379,000	38,621,969.04	1.83
2	019666	22国债01	262,000	26,494,050.14	1.26
3	019674	22国债09	146,000	14,656,372.00	0.70
4	019664	21国债16	141,230	14,355,495.53	0.68

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，中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构以及中国人民银行（含支行）的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。

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

除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	355,778.67
2	应收清算款	13,796,049.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,883,180.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,035,008.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
富荣沪深300指数增强A	105,859	5,350.11	175,667,619.69	31.0171%	390,689,615.03	68.9829%
富荣沪深300指数增强C	130,653	3,658.50	119,810,012.76	25.0651%	358,184,522.34	74.9349%
合计	231,798	4,505.44	295,477,632.45	28.2929%	748,874,137.37	71.7071%

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	富荣沪深300指数增强A	599,284.09	0.11%
	富荣沪深300指数增强C	39,777.58	0.01%

	合计	639,061.67	0.06%
--	----	------------	-------

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	富荣沪深300指数增强A	50~100
	富荣沪深300指数增强C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	富荣沪深300指数增强A	0~10
	富荣沪深300指数增强C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C
基金合同生效日(2019年01月24日)基金份额总额	70,918.32	19,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	279,362,284.65	429,883,932.66
本报告期基金总申购份额	405,734,769.09	311,384,130.43
减：本报告期基金总赎回份额	118,739,819.02	263,273,527.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	566,357,234.72	477,994,535.10

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，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

本报告期内涉及本基金管理人与劳动者诉讼案例一起，对管理人及基金运作无重大影响。

本报告期内无涉及基金财产、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

本报告期内，深圳证监局现场检查对管理人出具了行政监管措施，管理人已按要求进行整改。

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	
安信证券	1	382,224,937.06	13.00%	287,164.32	13.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	152,702,774.69	5.19%	114,726.14	5.19%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	300,400,897.50	10.22%	225,693.56	10.22%	-

金元证券	1	254,606,835.50	8.66%	191,288.94	8.66%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	235,323,548.59	8.00%	176,796.29	8.00%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	106,013,758.57	3.61%	79,648.96	3.61%	-
兴业证券	2	242,209,028.25	8.24%	181,972.93	8.24%	-
中信证券	2	311,866,917.68	10.61%	234,304.37	10.61%	-
东方财富 证券	3	955,325,035.48	32.49%	717,737.66	32.49%	-

(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新开交易席位为东方财富证券。

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
安信证券	38,445,448.50	29.84%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	48,827,256.72	37.90%	696,000,000.00	80.72%	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	26,399,227.68	20.49%	-	-	-	-	-	-
中信证券	505,895.30	0.39%	166,200,000.00	19.28%	-	-	-	-
东方财富 证券	14,650,256.01	11.37%	-	-	-	-	-	-

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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-01-01
2	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报	2022-01-21
3	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年第4季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-01-24
4	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-03-31
5	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国工商银行作为销售机构的公告	中国证券报	2022-04-13
6	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年第1季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-22
7	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增和讯信息科技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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-25
8	富荣基金管理有限公司关于旗下基金参加北京创金启富基金销售有限公司基金认购、申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-25
9	富荣基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯信息科技有限公司基金认购、申购及定期定额投资申购费率优惠	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-25

	活动的公告		
10	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增北京创金启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的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-25
11	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券股份有限公司为销售机构并开通基金定期 定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
12	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券股份有限公司基金认购、申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
13	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中山证券有限责任公司为销售机构并开通基金定期 定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
14	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中山证券有限责任公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
15	富荣基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
16	富荣基金管理有限公司关于开展旗下基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-30

17	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-05-17
18	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-06-21
19	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-06-23
20	富荣基金管理有限公司关于旗下基金参加华安证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、证券日报	2022-06-27

§ 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

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人公告：总经理、首席信息官高峰于2022年8月15日离任，董事长杨小舟代行总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案。

§ 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沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 12.1.2 《富荣沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《富荣沪深300指数增强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 报告期内富荣沪深300指数增强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
二〇二二年八月三十一日