

富荣沪深 300 指数增强型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	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遵规守信情况的说明	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	13
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遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	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	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§9 开放式基金份额变动	58
§10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§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	1,075,780,693.88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	518,458,521.07份	557,322,172.81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	杨小舟	张姗
	联系电话	0755-84356633	0755-83077987
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-685-5600	95555
传真		0755-83230787	0755-83195201
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房	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		王亦伟	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 (2023年01月01日-2023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	-4,641,535.07	-5,631,717.13
本期利润	-22,057,747.12	-30,111,107.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0402	-0.0511
本期加权平均净值利润率	-2.18%	-2.78%
本期基金份额净值增长率	-2.65%	-2.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	282,635,371.33	297,982,663.28
期末可供分配基金份额利润	0.5451	0.5347
期末基金资产净值	917,894,252.43	981,058,766.01
期末基金份额净值	1.7704	1.7603
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	145.75%	144.62%

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	2.71%	0.99%	1.10%	0.83%	1.61%	0.16%
过去三个月	-4.11%	0.87%	-4.88%	0.79%	0.77%	0.08%
过去六个月	-2.65%	0.82%	-0.69%	0.80%	-1.96%	0.02%
过去一年	-12.45%	1.02%	-13.60%	0.94%	1.15%	0.08%
过去三年	32.82%	1.24%	-7.07%	1.14%	39.89%	0.10%
自基金合同 生效起至今	145.75%	1.27%	21.68%	1.19%	124.07%	0.08%

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	2.70%	0.99%	1.10%	0.83%	1.60%	0.16%
过去三个月	-4.13%	0.87%	-4.88%	0.79%	0.75%	0.08%
过去六个月	-2.70%	0.82%	-0.69%	0.80%	-2.01%	0.02%
过去一年	-12.54%	1.02%	-13.60%	0.94%	1.06%	0.08%
过去三年	32.42%	1.24%	-7.07%	1.14%	39.49%	0.10%
自基金合同 生效起至今	144.62%	1.27%	21.68%	1.19%	122.94%	0.08%

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



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



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		
郎骋成	研究部总经理、基金经理	2020-07-16	-	16.5	硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任锦泰期货有限公司宏观和化工研究员、金东矿业股份有限公司主持上市办公室工作、弘业期货股份有限公司投资咨询负责人及研究所所长、摩根士丹利华鑫基金另类投资小组副组长/专户投资经理/专户理财部副总监。2020年6月加入富荣基金。

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。

4.1.3 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	2,110,745,550.44	2020-07-16

私募资产管理计划	3	53,189,582.66	2020-09-22
其他组合	-	-	-
合计	6	2,163,935,133.10	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、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

本基金运用主动量化的方法对沪深300成分股进行组合优化，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。在增强策略的选择上，我们参考宏观模型给出结论对行业权重进行调整。个股选择上借鉴主动权益研究的方法，对成分股的企业治理、经营状况进行综合评价，寻找在未来两到三年具有较好估值性价比的公司构建组合。我们也会定期跟踪评估宏观、行业和持仓公司的相关数据，根据评估结果积极调整行业分布和个股选择，以期产生持续稳定的超额收益。

2023年上半年，市场活跃但赚钱效应不强。在经历了2022年四季度对于经济复苏的高预期之后，报告期内市场对于经济前景出现了较大幅度的回摆，不确定性的增加导致市场对于行业短周期的景气度关注度大幅下降，资金逐步往中短期无法证伪但长期想象空间巨大的主题方向集中。资金再配置的过程中，A股市场出现了明显的分化，小市值

和低估值的股票因为边际资金的快速涌入而大幅上涨，而前两年备受关注的蓝筹和成长股遭到抛售，由此带来主要宽基指数收益率的明显分层。其中，上证综指上涨3.65%，上证50指数下跌5.43%，沪深300指数下跌0.75%，创业板指下跌5.61%，科创50上涨4.71%。从申万一级行业指数看，科技方向表现抢眼，通信、传媒和计算机分别上涨50.66%、42.75%和27.57%。而受到经济复苏节奏偏缓的影响，消费相关的行业表现欠佳，商贸零售、房地产、美容护理分别下跌23.44%、14.29%、13.61%，在31个一级行业中跌幅居前。

报告期内，本基金稳健运作，仓位基本稳定。

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1.7704元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.65%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%；截至报告期末富荣沪深300指数增强C基金份额净值为1.7603元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.70%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年上半年，市场对于我国经济前景的预期发生了180度的转变。从一季度的乐观到二季度的悲观，伴随着地产销售不及预期、基建投资放缓等宏观数据的公布以及大宗商品的持续下跌，6月开始有观点认为随着居民资产负债表的衰退，私人部门会持续减少消费，导致中国将进入一个类似90年代日本的长期通缩的经济下行状态。不可否认，读数上看我国经济现在显然面临着挑战，无论是CPI还是PPI都在证明这一点。但这些困难会不会导致长期的经济问题？我们认为发生的可能性不大。当前的悲观预期更像是可得性偏差的结果：“政策保持定力”下经济复苏节奏低于市场的期待，拉扯着情绪从一个极端来到另一个极端，在这个过程中缓慢修复的宏观数据形成了自我加强的结果。我们认为，无论是地产还是库存，都已经呈现出阶段性底部区间的迹象，中国经济和A股市场都值得期待。

首先看地产。根据国家统计局公布的数据，截至2023年1-6月住宅销售面积5.16亿平方米，同比下滑11.13%，按历史经验推算2023年销售面积大约在10.2亿平方米左右，回到2012年的水平。但新开工面积掉的更多，2022年住宅新开工面积下降40%至8.8亿平方米，创下2008年次贷危机以来的新低，今年前6个月继续同比下降25.53%至3.63亿平方米。在供应快速下降的背景下，即使考虑未来几年销售面积进一步下滑，存量商品房的库存也可以被逐步消化掉，不太可能出现房价持续下跌、成交量萎缩又持续下跌的负反馈。我们认为，房地产这种长周期的资产需要在一个更长的时间框架下才能解释，目前的量价齐跌是行业进入主动去库存阶段的显性表现，是地产经历了长达十多年的牛市之后一次中期的调整。事实上，经过2020年三条红线、2022年债务违约之后，我国房地产市场

的供应能力已经被很大程度的约束住了。我们相信，随着利率、限购等政策的渐次调整，未来两三个季度可能会逐渐见到地产的中期底部。

其次是库存。历史数据表明，一轮库存周期通常持续3-4年，经验数据指导我们始于2020年新冠疫情导致的国内被动补库存阶段和全球海运费上涨导致的海外主动补库存阶段正在或者已经接近尾声。抛开理论看真实世界，我们拆解我国二季度数据后发现，价格因素的负向拖累可能被市场所低估，刨除价格影响后的固定资产投资同比增速已经企稳甚至向上。价格因素很大程度上来自于外生，这和汇率、利率等因素的持续压力没有得到根本改善有关系。即便如此，6月PMI数据中我们观察到价格指数的初步企稳。6月PMI原材料购进价格指数和出厂价格指数分别为45.0%和43.9%，分别较上月上涨4.2个百分点和2.3个百分点。价格水平的企稳的同时，6月原材料库存指数和产成品库存指数分别较上月下降0.2、2.8个百分点，说明中国的库存周期正在向被动去库存过渡，去库存进入后半程。由于盈利周期的波动一定程度上领先于库存周期，我们对A股上市公司盈利触底充满信心。

站在当下，国内经济的复苏短期依旧很难去证明或者证伪，供给端的改善和需求端的修复并不同步，导致了2023年至今企业盈利没有看到明显的复苏。但基于我们对周期的理解，叠加当前A股估值又重新回到历史最低的10%分位附近，我们认为极低的资产价格已经可以产生比较好的收益回报，当前或已经是主动承担风险的好时机。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、基金事务部、监察稽核部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

截止2023年6月30日，根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

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：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	87,714,043.72	99,501,419.41
结算备付金		26,465,110.76	44,682,444.95
存出保证金		315,885.21	281,273.23
交易性金融资产	6.4.7.2	1,807,377,555.53	1,946,982,488.68
其中：股票投资		1,719,749,627.04	1,882,055,777.47
基金投资		-	-
债券投资		87,627,928.49	64,926,711.21
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		7,603,722.70	36,490,068.11
应收股利		-	-
应收申购款		3,412,685.32	5,483,570.67

递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,932,889,003.24	2,133,421,265.05
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2023年06月30日	2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,585,378.76	2,129,186.05
应付赎回款		27,954,366.07	2,707,951.42
应付管理人报酬		952,883.44	1,060,847.65
应付托管费		158,813.91	176,807.93
应付销售服务费		83,375.71	85,994.33
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	1,201,166.91	1,319,393.73
负债合计		33,935,984.80	7,480,181.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	1,075,780,693.88	1,172,000,341.98
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	823,172,324.56	953,940,741.96
净资产合计		1,898,953,018.44	2,125,941,083.94
负债和净资产总计		1,932,889,003.24	2,133,421,265.05

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额1,075,780,693.88份。A类基金份额净值人民币1.7704元，基金份额总额518,458,521.07份。C类基金份额净值人民币1.7603元，基金份额总额557,322,172.81份。

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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-44,060,907.68	-57,071,002.03
1.利息收入		318,774.87	473,612.00
其中：存款利息收入	6.4.7.8	318,774.87	359,973.11
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		-	113,638.89
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-3,091,737.38	9,849,679.80
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-31,536,445.03	-5,493,377.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	986,391.78	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	6.4.7.11	-	-
股利收益	6.4.7.12	27,458,315.87	14,521,364.39
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	6.4.7.13	-41,895,602.31	-68,275,373.84

以“-”号填列)			
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	607,657.14	881,080.01
减：二、营业总支出		8,107,946.83	6,886,922.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,248,046.67	5,298,267.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,041,341.10	883,044.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	536,702.84	451,771.45
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		0.50	0.28
8. 其他费用	6.4.7.15	281,855.72	253,838.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-52,168,854.51	-63,957,924.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-52,168,854.51	-63,957,924.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-52,168,854.51	-63,957,924.99

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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综	未分配利润	净资产合计

		合收益		
一、上期期末净资产（基金净值）	1,172,000,341.98	-	953,940,741.96	2,125,941,083.94
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）	1,172,000,341.98	-	953,940,741.96	2,125,941,083.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,219,648.10	-	-130,768,417.40	-226,988,065.50
（一）、综合收益总额	-	-	-52,168,854.51	-52,168,854.51
（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）	-96,219,648.10	-	-78,599,562.89	-174,819,210.99
其中：1.基金申购款	416,136,027.44	-	360,929,644.96	777,065,672.40
2.基金赎回款	-512,355,675.54	-	-439,529,207.85	-951,884,883.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产（基金净值）	1,075,780,693.88	-	823,172,324.56	1,898,953,018.44
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	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

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×95%+银行活期存款利率（税后）×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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日及2022年12月31日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023年6月30日和2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1

日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金

从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023年06月30日	
活期存款	87,714,043.72	
等于：本金	87,704,482.75	
加：应计利息	9,560.97	
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	87,714,043.72	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,063,928,801.05	-	1,719,749,627.04	-344,179,174.01
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	86,287,475.00	1,457,138.49	87,627,928.49	-116,685.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	86,287,475.00	1,457,138.49	87,627,928.49	-116,685.00
资产支持证券	-	-	-	-	-
基金	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	2,150,216,276.05	1,457,138.49	1,807,377,555.53	-344,295,859.01	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	214.37
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	925,242.00
其中：交易所市场	925,242.00
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
其他应付	166,614.60
合计	1,201,166.91

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	591,518,699.30	591,518,699.30
本期申购	123,299,150.30	123,299,150.30
本期赎回（以“-”号填列）	-196,359,328.53	-196,359,328.53
本期末	518,458,521.07	518,458,521.07

6.4.7.6.2 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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	580,481,642.68	580,481,642.68
本期申购	292,836,877.14	292,836,877.14
本期赎回（以“-”号填列）	-315,996,347.01	-315,996,347.01
本期末	557,322,172.81	557,322,172.81

注:申购包含基金转入的份额及金额;赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 富荣沪深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	327,566,370.67	156,679,089.59	484,245,460.26
本期利润	-4,641,535.07	-17,416,212.05	-22,057,747.12
本期基金份额交易产	-40,289,464.27	-22,462,517.51	-62,751,981.78

生的变动数			
其中：基金申购款	67,835,875.66	39,453,569.42	107,289,445.08
基金赎回款	-108,125,339.93	-61,916,086.93	-170,041,426.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	282,635,371.33	116,800,360.03	399,435,731.36

6.4.7.7.2 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	315,875,041.99	153,820,239.71	469,695,281.70
本期利润	-5,631,717.13	-24,479,390.26	-30,111,107.39
本期基金份额交易产生的变动数	-12,260,661.58	-3,586,919.53	-15,847,581.11
其中：基金申购款	158,526,658.11	95,113,541.77	253,640,199.88
基金赎回款	-170,787,319.69	-98,700,461.30	-269,487,780.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	297,982,663.28	125,753,929.92	423,736,593.20

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	238,506.76
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	77,734.56
其他	2,533.55
合计	318,774.87

注：其他为交易保证金利息收入。

6.4.7.9 股票投资收益**6.4.7.9.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	1,411,715,631.03
减：卖出股票成本总额	1,439,585,113.75
减：交易费用	3,666,962.31
买卖股票差价收入	-31,536,445.03

6.4.7.10 债券投资收益**6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	893,723.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	92,668.15
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	986,391.78

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	48,491,502.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	47,490,740.03
减：应计利息总额	908,063.08
减：交易费用	31.33

买卖债券差价收入	92,668.15
----------	-----------

6.4.7.11 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	27,458,315.87
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	27,458,315.87

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-41,895,602.31
——股票投资	-41,940,587.31
——债券投资	44,985.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-41,895,602.31

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	607,525.03
转换费收入	132.11
合计	607,657.14

注：本基金的A类基金份额、C类基金份额的赎回费率按基金份额持有期限递减，A类基金份额，对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期不少于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费总额的50%计入基金财产；就C类基金份额，收取的赎回费全额计入基金财产。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,145.18
指数使用费	166,614.60
合计	281,855.72

6.4.7.16 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富荣基金管理有限公司	基金管理人、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 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,248,046.67	5,298,267.90
其中：支付销售机构的客户维护费	2,292,003.98	1,831,677.06

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,041,341.10	883,044.56

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 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	78,337.65	78,337.65
合计	0.00	78,337.65	78,337.65
获得销售服	上年度可比期间		

务费的各关联方名称	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
合计	0.00	77,185.86	77,185.86

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均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及上年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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	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	87,714,043.72	238,506.76	108,554,393.89	160,116.36

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的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

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（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	科创板打新限售	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个交易日	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新限售	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个交易日	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个交易日	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	创业板打新限售	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新限售	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301202	朗威股份	2023-06-28	5个交易日	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个交易日	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	7个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板打新限售	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-

688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	科创板打新限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688352	硕中科技	2023-04-11	6个月	科创板打新限售	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6个月	创业板打新限售	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	科创板打新限售	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	创业板打新限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	创业板打新限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	科创板打新限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	科创板打新限售	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	创业板打新限售	87.30	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	创业板打新限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	创业板打新限售	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301439	泓淋	2023-03-10	6个月	创业板打	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-

	电力			新限售						
688623	二元科技	2023-05-31	6个月	科创板打新限售	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	创业板打新限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	创业板打新限售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	创业板打新限售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	科创板打新限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	科创板打新限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	科创板打新限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	科创板打新限售	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	创业板打新限售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	科创板打新限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-

301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	创业板打 新限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩 汽电	2023-06-26	6个月	创业板打 新限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐 集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯 信息	2023-06-19	6个月	科创板打 新限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车 科技	2023-05-04	6个月	科创板打 新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃 科技	2023-06-08	6个月	创业板打 新限售	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧 科技	2023-06-14	6个月	创业板打 新限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王 科技	2023-06-02	6个月	创业板打 新限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301386	未来 电器	2023-03-21	6个月	创业板打 新限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱 福	2023-05-29	6个月	创业板打 新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创 能源	2023-06-20	6个月	科创板打 新限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮 科技	2023-01-20	6个月	创业板打 新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301170	锡南 科技	2023-06-16	6个月	创业板打 新限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
688535	华海 诚科	2023-03-28	6个月	科创板打 新限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚 股份	2023-03-31	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301202	朗威 股份	2023-06-28	6个月	创业板打 新限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承 科技	2023-06-30	6个月	科创板打 新限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
300804	广康 生化	2023-06-15	6个月	创业板打 新限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工 精密	2023-06-29	6个月	创业板打 新限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华 电子	2023-05-16	6个月	创业板打 新限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪 恒通	2023-05-10	6个月	创业板打 新限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬	2023-05-09	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-

	科技									
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金及混合型基金，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2023年06月30日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2022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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	40,140,528.60	24,915,884.22
合计	40,140,528.60	24,915,884.22

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、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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	47,487,399.89	40,010,826.99
合计	47,487,399.89	40,010,826.99

注:1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债及央行票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所或银行间市场上市的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	87,714,043.72	-	-	-	87,714,043.72
结算备付金	26,465,110.76	-	-	-	26,465,110.76
存出保证金	315,885.21	-	-	-	315,885.21
交易性金融资产	87,627,928.49	-	-	1,719,749,627.04	1,807,377,555.53
应收清算款	-	-	-	7,603,722.70	7,603,722.70
应收申购款	-	-	-	3,412,685.32	3,412,685.32
资产总计	202,122,968.18	-	-	1,730,766,035.06	1,932,889,003.24
负债					
应付清算款	-	-	-	3,585,378.76	3,585,378.76
应付赎回款	-	-	-	27,954,366.07	27,954,366.07
应付管理人报酬	-	-	-	952,883.44	952,883.44
应付托管费	-	-	-	158,813.91	158,813.91
应付销售服务费	-	-	-	83,375.71	83,375.71
其他负债	-	-	-	1,201,166.91	1,201,166.91
负债总计	-	-	-	33,935,984.80	33,935,984.80
利率敏感度缺口	202,122,968.18	-	-	不适用	不适用
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	99,501,419.41	-	-	-	99,501,419.41
结算备付金	44,682,444.95	-	-	-	44,682,444.95
存出保证金	281,273.23	-	-	-	281,273.23

交易性金融资产	64,926,711.21	-	-	1,882,055,777.47	1,946,982,488.68
应收清算款	-	-	-	36,490,068.11	36,490,068.11
应收申购款	-	-	-	5,483,570.67	5,483,570.67
资产总计	209,391,848.80	-	-	1,924,029,416.25	2,133,421,265.05
负债					
应付清算款	-	-	-	2,129,186.05	2,129,186.05
应付赎回款	-	-	-	2,707,951.42	2,707,951.42
应付管理人报酬	-	-	-	1,060,847.65	1,060,847.65
应付托管费	-	-	-	176,807.93	176,807.93
应付销售服务费	-	-	-	85,994.33	85,994.33
其他负债	-	-	-	1,319,393.73	1,319,393.73
负债总计	-	-	-	7,480,181.11	7,480,181.11
利率敏感度缺口	209,391,848.80	-	-	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2023年06月30日，本基金持有交易性债券市值占资产净值的4.54%（2022年12月31日：3.05%），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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，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 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

交易性金融资产 — 股票投资	1,719,749,627.04	90.56	1,882,055,777.47	88.53
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	87,627,928.49	4.61	64,926,711.21	3.05
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	1,807,377,555.53	95.18	1,946,982,488.68	91.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	91,156,247.82	112,432,126.96
基金业绩比较基准下降5%	-91,156,247.82	-112,432,126.96	

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,717,676,202.88	1,879,960,833.61
第二层次	88,215,441.47	65,312,574.61
第三层次	1,485,911.18	1,709,080.46
合计	1,807,377,555.53	1,946,982,488.68

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) 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2023年8月29日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,719,749,627.04	88.97
	其中：股票	1,719,749,627.04	88.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	87,627,928.49	4.53
	其中：债券	87,627,928.49	4.53
	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	114,179,154.48	5.91
8	其他各项资产	11,332,293.23	0.59
9	合计	1,932,889,003.24	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	4,560,630.00	0.24
B	采矿业	2,709,471.00	0.14
C	制造业	1,104,254,484.79	58.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,639,294.00	0.88
E	建筑业	40,242,634.00	2.12
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	56,533,805.00	2.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	307,756,990.00	16.21
K	房地产业	73,919,460.09	3.89
L	租赁和商务服务业	55,402,755.00	2.92
M	科学研究和技术服务业	41,834,934.00	2.20
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	1,703,854,457.88	89.73

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	-	-
C	制造业	1,844,491.58	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	53,486.97	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	76,478.08	0.00
J	金融业	13,821,745.00	0.73
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	14,394.48	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,895,169.16	0.84

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	65,000	109,915,000.00	5.79
2	300750	宁德时代	400,000	91,516,000.00	4.82
3	601318	中国平安	1,552,500	72,036,000.00	3.79
4	002027	分众传媒	8,135,500	55,402,755.00	2.92
5	000001	平安银行	4,766,900	53,532,287.00	2.82
6	000858	五粮液	325,500	53,242,035.00	2.80
7	600660	福耀玻璃	1,359,267	48,729,721.95	2.57
8	002142	宁波银行	1,846,220	46,709,366.00	2.46
9	300014	亿纬锂能	765,600	46,318,800.00	2.44
10	600031	三一重工	2,686,200	44,671,506.00	2.35
11	603259	药明康德	671,400	41,834,934.00	2.20
12	601377	兴业证券	6,752,200	41,323,464.00	2.18

13	600048	保利发展	3,028,503	39,461,394.09	2.08
14	300122	智飞生物	880,200	38,904,840.00	2.05
15	000333	美的集团	646,800	38,109,456.00	2.01
16	600745	闻泰科技	771,369	37,719,944.10	1.99
17	600585	海螺水泥	1,559,500	37,022,530.00	1.95
18	002049	紫光国微	365,600	34,092,200.00	1.80
19	601012	隆基绿能	1,155,900	33,139,653.00	1.75
20	002271	东方雨虹	1,175,500	32,044,130.00	1.69
21	600887	伊利股份	1,128,300	31,953,456.00	1.68
22	603799	华友钴业	683,500	31,379,485.00	1.65
23	002415	海康威视	947,700	31,378,347.00	1.65
24	300760	迈瑞医疗	103,800	31,119,240.00	1.64
25	002648	卫星化学	1,981,000	29,635,760.00	1.56
26	600309	万华化学	333,900	29,329,776.00	1.54
27	600196	复星医药	809,200	25,004,280.00	1.32
28	601166	兴业银行	1,559,400	24,404,610.00	1.29
29	000733	振华科技	253,600	24,307,560.00	1.28
30	002475	立讯精密	733,000	23,785,850.00	1.25
31	601111	中国国航	2,787,200	22,966,528.00	1.21
32	688599	天合光能	526,800	22,446,948.00	1.18
33	300124	汇川技术	346,600	22,255,186.00	1.17
34	002459	晶澳科技	532,700	22,213,590.00	1.17
35	002311	海大集团	461,200	21,602,608.00	1.14
36	001979	招商蛇口	1,592,400	20,748,972.00	1.09
37	601668	中国建筑	3,600,100	20,664,574.00	1.09
38	600989	宝丰能源	1,584,900	19,985,589.00	1.05
39	601117	中国化学	2,364,500	19,578,060.00	1.03
40	002352	顺丰控股	432,100	19,483,389.00	1.03
41	601658	邮储银行	3,937,200	19,252,908.00	1.01
42	600919	江苏银行	2,603,400	19,134,990.00	1.01
43	300408	三环集团	648,300	19,027,605.00	1.00

44	601601	中国太保	719,200	18,684,816.00	0.98
45	000708	中信特钢	1,151,716	18,243,181.44	0.96
46	600011	华能国际	1,796,900	16,639,294.00	0.88
47	600809	山西汾酒	87,900	16,267,653.00	0.86
48	002466	天齐锂业	209,000	14,611,190.00	0.77
49	600233	圆通速递	967,300	14,083,888.00	0.74
50	600383	金地集团	1,901,400	13,709,094.00	0.72
51	000776	广发证券	861,900	12,678,549.00	0.67
52	002493	荣盛石化	778,300	9,059,412.00	0.48
53	300223	北京君正	73,200	6,464,292.00	0.34
54	688005	容百科技	113,300	6,120,466.00	0.32
55	002714	牧原股份	108,200	4,560,630.00	0.24
56	601899	紫金矿业	238,300	2,709,471.00	0.14
57	300661	圣邦股份	32,110	2,637,194.30	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	601825	沪农商行	2,536,100	13,821,745.00	0.73
2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
3	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
4	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
5	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
6	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
7	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
8	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
9	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
10	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
11	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
12	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00

13	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
14	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
15	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
16	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
17	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
18	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
19	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
20	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
21	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
22	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
23	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
24	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
25	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
26	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
27	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
28	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
29	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
30	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
31	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
32	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
33	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
34	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
35	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
36	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
37	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
38	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
39	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
40	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
41	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
42	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
43	688593	新相微	959	13,991.81	0.00

44	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
45	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
46	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
47	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
48	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
49	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
50	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
51	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
52	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
53	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
54	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
55	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
56	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
57	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
58	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
59	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
60	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
61	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
62	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
63	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
64	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
65	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
66	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
67	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
68	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
69	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
70	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
71	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
72	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
73	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
74	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00

75	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
76	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
77	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
78	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
79	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	002049	紫光国微	49,303,322.00	2.32
2	002459	晶澳科技	44,690,230.90	2.10
3	300014	亿纬锂能	43,516,152.23	2.05
4	603799	华友钴业	38,905,982.96	1.83
5	002271	东方雨虹	37,839,344.28	1.78
6	600585	海螺水泥	37,096,287.44	1.74
7	600519	贵州茅台	31,376,084.00	1.48
8	600309	万华化学	31,063,535.58	1.46
9	300124	汇川技术	29,494,338.88	1.39
10	601318	中国平安	28,515,751.00	1.34
11	600989	宝丰能源	28,325,599.00	1.33
12	002311	海大集团	27,779,260.93	1.31
13	600919	江苏银行	26,532,089.40	1.25
14	601111	中国国航	26,180,334.10	1.23
15	002594	比亚迪	25,912,794.39	1.22
16	001979	招商蛇口	25,810,098.00	1.21
17	002714	牧原股份	24,372,212.00	1.15
18	601225	陕西煤业	24,312,397.00	1.14
19	600233	圆通速递	24,041,197.00	1.13
20	000776	广发证券	23,826,934.92	1.12

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	601658	邮储银行	84,272,537.00	3.96
2	600030	中信证券	51,529,190.99	2.42
3	601601	中国太保	48,699,031.00	2.29
4	601318	中国平安	42,008,551.54	1.98
5	000858	五粮液	41,018,310.19	1.93
6	002493	荣盛石化	37,744,789.00	1.78
7	002459	晶澳科技	35,968,836.78	1.69
8	601225	陕西煤业	35,600,986.00	1.67
9	600519	贵州茅台	34,753,727.00	1.63
10	601288	农业银行	33,862,889.00	1.59
11	600741	华域汽车	32,634,882.00	1.54
12	601117	中国化学	31,524,267.00	1.48
13	601012	隆基绿能	28,616,754.48	1.35
14	600900	长江电力	26,855,280.00	1.26
15	002594	比亚迪	25,957,616.00	1.22
16	300059	东方财富	24,487,289.26	1.15
17	600690	海尔智家	23,075,828.00	1.09
18	002371	北方华创	22,337,185.00	1.05
19	002714	牧原股份	21,652,089.68	1.02
20	300763	锦浪科技	19,737,212.73	0.93

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	1,319,219,550.63
卖出股票收入（成交）总额	1,411,715,631.03

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	87,627,928.49	4.61
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	87,627,928.49	4.61

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	019638	20国债09	464,000	47,487,399.89	2.50
2	019694	23国债01	397,000	40,140,528.60	2.11

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	315,885.21
2	应收清算款	7,603,722.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,412,685.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,332,293.23

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301395	仁信新材	138,629.28	0.01	新股未上市
2	688249	晶合集成	133,734.30	0.01	科创板打新限售
3	301292	海科新源	116,421.76	0.01	新股未上市
4	688472	阿特斯	106,687.44	0.01	科创板打新限售

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
富荣沪深300指数增强A	76,701	6,759.48	92,232,356.75	17.7897%	426,226,164.32	82.2103%
富荣沪深300指数增强C	133,443	4,176.48	84,736,858.97	15.2043%	472,585,313.84	84.7957%
合计	205,558	5,233.47	176,969,215.72	16.4503%	898,811,478.16	83.5497%

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	221,891.50	0.04%
	富荣沪深300指数增强C	25,753.76	0.00%
	合计	247,645.26	0.02%

注：①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）。

②期末基金管理人的从业人员持有本基金占基金总份额比例展示为0，为保留位数导致。

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	富荣沪深300指数增强A	10~50
	富荣沪深300指数增强C	0
	合计	10~50
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	10~50
	富荣沪深300指数增强C	0
	合计	10~50

§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	591,518,699.30	580,481,642.68
本报告期基金总申购份额	123,299,150.30	292,836,877.14
减：本报告期基金总赎回份额	196,359,328.53	315,996,347.01

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	518,458,521.07	557,322,172.81

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

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未出现变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有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	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	233,208,163.05	8.59%	175,210.79	8.59%	-
华安证券	1	203,684,714.07	7.50%	153,028.79	7.50%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	879,947,144.55	32.42%	661,102.29	32.42%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	592,638,146.23	21.83%	445,248.58	21.83%	-
中信证券	2	428,214,390.67	15.77%	321,716.86	15.77%	-
东方财富证券	3	376,872,601.66	13.88%	283,148.18	13.88%	-

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未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	783,582.59	1.13%	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-

开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	29,111,350.02	41.83%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	39,694,045.01	57.04%	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年第4季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
2	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加销售机构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、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-03
3	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-03
4	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
5	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-15
6	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江海证券有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-20

	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		
7	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年年度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
8	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-07
9	富荣基金管理有限公司住所变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-12
10	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第1季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24
11	富荣基金管理有限公司关于总经理代为履行督察长职务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
12	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
13	富荣基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-17

§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：

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

2、公司法定代表人变更为王亦伟，上述变动已完成工商变更登记。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准富荣沪深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
二〇二三年八月三十一日