

富荣医药健康混合型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣医药健康混合型发起式证券投资基金	
基金简称	富荣医药健康混合发起	
基金主代码	015655	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年06月28日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	16,468,204.40份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣医药健康混合发起A	富荣医药健康混合发起C
下属分级基金的交易代码	015655	015656
报告期末下属分级基金的份额总额	15,531,239.85份	936,964.55份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选医药健康行业优质企业，在严格控制风险的前提下，力争基金资产长期稳健增值，为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用的投资策略有：大类资产配置、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资业务投资策略等。本基金所指的医药健康相关行业，是在中国经济科技不断发展、人口老龄化程度提高的背景下，可以满足人民日益增长的健康保健需要及美好生活需求的行业。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富荣基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	任晓伟	滕菲菲
	联系电话	0755-84356633	4006800000
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-685-5600	95558
传真		0755-83230787	010-85230024
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		518038	100020
法定代表人		王亦伟	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.furamc.com.cn/
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富荣基金管理有限公司	深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	富荣医药健康混合 发起A	富荣医药健康混合 发起C
本期已实现收益	-1,755,287.42	-104,858.22
本期利润	-2,227,162.82	-139,234.61
加权平均基金份额本期利润	-0.1439	-0.1505
本期加权平均净值利润率	-18.53%	-19.52%
本期基金份额净值增长率	-16.73%	-16.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-4,405,145.39	-271,134.33
期末可供分配基金份额利润	-0.2836	-0.2894
期末基金资产净值	11,126,094.46	665,830.22
期末基金份额净值	0.7164	0.7106
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-28.36%	-28.94%

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

富荣医药健康混合发起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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	-7.37%	1.15%	-6.19%	0.72%	-1.18%	0.43%
过去三个月	-7.33%	1.15%	-7.96%	0.82%	0.63%	0.33%
过去六个月	-16.73%	1.48%	-15.91%	1.13%	-0.82%	0.35%
过去一年	-21.15%	1.29%	-18.51%	1.02%	-2.64%	0.27%
自基金合同生效起至今	-28.36%	1.26%	-28.84%	1.09%	0.48%	0.17%

富荣医药健康混合发起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	-7.41%	1.15%	-6.19%	0.72%	-1.22%	0.43%
过去三个月	-7.44%	1.15%	-7.96%	0.82%	0.52%	0.33%
过去六个月	-16.90%	1.48%	-15.91%	1.13%	-0.99%	0.35%
过去一年	-21.48%	1.29%	-18.51%	1.02%	-2.97%	0.27%
自基金合同生效起至今	-28.94%	1.26%	-28.84%	1.09%	-0.10%	0.17%

注：本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富荣医药健康混合发起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

(2022年06月28日-2024年06月30日)



富荣医药健康混合发起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

(2022年06月28日-2024年06月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富荣基金管理有限公司成立于2016年1月25日，是中国证监会批准成立的国内第101家公募基金管理公司。公司注册地为广州市南沙区，办公地位于深圳市福田区八卦岭八卦四路安吉尔大厦24楼，注册资本金人民币2亿元。富荣基金定位于“综合金融服务商”，围绕客户需求，贯彻投资人利益优先原则，秉持“规范创造价值，创新推动成长”的经营理念，努力打造企业核心竞争力，整合产业上下游资源，为各类投资者提供充分满足个性需求的产品，并以稳定、持续、优秀的投资业绩和全面、及时、优质的服务回报投资者的信任，与投资者共同分享中国经济发展的成果，致力成为受人尊重、有价值的综合金融服务企业领先者。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李黄海	基金经理	2022-06-28	-	17.5	博士研究生，持有基金从业资格，中国国籍。曾任摩根士丹利华鑫数量化投资部投资经理、平安基金量化投资部总监等职务。2020年7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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

今年第一季度，我们采取了较为进取的投资策略。

但今年第二季度，医药行业指数没有继续第一季度的涨势，在震荡后反复下跌，中证医药卫生指数在本报告期末更是创出今年以来的最低收市价，显然医药行业仍然没有摆脱弱势走势。

报告期内，我们的配置在保持进攻的同时，兼顾一定比例的防守策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣医药健康混合发起A基金份额净值为0.7164元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.73%，同期业绩比较基准收益率为-15.91%；截至报告期末富荣医药健康混合发起C基金份额净值为0.7106元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.90%，同期业绩比较基准收益率为-15.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国务院总理李强7月5日主持召开国务院常务会议，审议通过《全链条支持创新药发展实施方案》。会议指出，发展创新药关系医药产业发展，关系人民健康福祉；要全链条强化政策保障，统筹用好价格管理、医保支付、商业保险、药品配备使用、投融资等政策，优化审评审批和医疗机构考核机制，合力助推创新药突破发展；要调动各方面科技创新资源，强化新药创制基础研究，夯实我国创新药发展根基。

自此，创新药产业早有期待的“大礼包”落地，使得几个月来多个城市（北京、广州、珠海、济南等）发布支持医药创新发展的政策征求意见稿得以实施。

近期，国家医保局医药管理司司长黄心宇在公开场合也详细阐述了医保如何支持创新药发展。据称，在过去6年期间新增744个“医保药”，加快创新药进入临床速度。数

据显示,2022年,医保对新药的支出从2019年的59.49亿元增长到481.89亿元,增长了7.1倍。

然而,报告期间,医药行业股价的走势却背离了利好政策。究其原因,我们认为:市场缺乏信心,缺乏新增资金,加之市场无风险利率不断走低,资金的投资方向集中在高股息板块,例如:银行、煤炭等行业;市场的跷跷板效应,使资金都扎堆到高股息板块;而诸如创新药等潜在盈利在数年以后的板块,反过来被不断抛售、其资金被大量抽离。这种资金行为,属于投资久期配置所致,并不完全反应投资价值基本面,反而可能为我们提供较好的投资机会。

因此,在宏观经济不景气、股市持续弱势的大背景下,我们基金的投资仍以防守为主,在此同时会关注我国创新药的投资机会。

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该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;基金份额持有人可对A类和C类基金份额选择不同的分红方式;同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式,如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同,则基金份额登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准;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；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一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。

本基金的基金合同于2022年06月28日生效，截止2024年6月30日，根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

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

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年。

§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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对富荣医药健康混合型发起式证券投资基金2024年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，富荣基金管理有限公司在富荣医药健康混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，富荣基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2024年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：富荣医药健康混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	93,211.79	110,082.37
结算备付金		-	-
存出保证金		349,017.83	1,323,277.51
交易性金融资产	6.4.7.2	11,388,239.88	12,666,285.08
其中：股票投资		10,679,662.48	12,666,285.08
基金投资		-	-
债券投资		708,577.40	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,069.55	1,102.43
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		11,835,539.05	14,100,747.39
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,423.98	820.53
应付管理人报酬		12,084.97	14,448.23
应付托管费		2,014.16	2,408.05
应付销售服务费		228.24	274.93
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	24,863.02	50,000.00
负债合计		43,614.37	67,951.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	16,468,204.40	16,316,526.60
未分配利润	6.4.7.7	-4,676,279.72	-2,283,730.95
净资产合计		11,791,924.68	14,032,795.65
负债和净资产总计		11,835,539.05	14,100,747.39

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额16,468,204.40份，其中，下属A类基金份额净值0.7164元，基金份额总额15,531,239.85份；下属C类基金份额净值0.7106元，基金份额总额936,964.55份。

6.2 利润表

会计主体：富荣医药健康混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-2,251,216.41	291,989.78
1.利息收入		911.86	2,001.18
其中：存款利息收入	6.4.7.8	911.86	2,001.18

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,746,793.84	519,649.17
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-1,902,445.31	352,896.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	4,365.94	-
资产支持证券投资	6.4.7.11	-	-
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	151,285.53	166,752.61
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	-506,251.79	-230,604.88
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	917.36	944.31
减：二、营业总支出		115,181.02	152,833.01
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	75,920.11	107,596.97
2.托管费	6.4.10.2.2	12,653.34	17,932.82
3.销售服务费	6.4.10.2.3	1,416.05	2,121.53
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.16	-	-

7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.17	25,191.52	25,181.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,366,397.43	139,156.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,366,397.43	139,156.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,366,397.43	139,156.77

6.3 净资产变动表

会计主体：富荣医药健康混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,316,526.60	-2,283,730.95	14,032,795.65
二、本期期初净资产	16,316,526.60	-2,283,730.95	14,032,795.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	151,677.80	-2,392,548.77	-2,240,870.97
（一）、综合收益总额	-	-2,366,397.43	-2,366,397.43
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	151,677.80	-26,151.34	125,526.46

其中：1.基金申购款	611,915.65	-131,849.39	480,066.26
2.基金赎回款	-460,237.85	105,698.05	-354,539.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	16,468,204.40	-4,676,279.72	11,791,924.68
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,065,508.67	-1,528,665.84	14,536,842.83
二、本期期初净资产	16,065,508.67	-1,528,665.84	14,536,842.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-762,565.54	126,077.11	-636,488.43
（一）、综合收益总额	-	139,156.77	139,156.77
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-762,565.54	-13,079.66	-775,645.20
其中：1.基金申购款	1,972,241.22	-99,608.12	1,872,633.10
2.基金赎回款	-2,734,806.76	86,528.46	-2,648,278.30
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产	-	-	-

变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	15,302,943.13	-1,402,588.73	13,900,354.40

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

富荣医药健康混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]778号文《关于准予富荣医药健康混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由富荣基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富荣医药健康混合型发起式证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于2022年6月28日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币12,856,842.65元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币4,595.62元，以上实收基金（本息）合计为人民币12,861,438.27元，折合12,861,438.27份基金份额。本基金的基金管理人为富荣基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中信银行股份有限公司。本基金为发起式基金，发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币1,000万元，且发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。根据《富荣医药健康混合型发起式证券投资基金基金合同》和《富荣医药健康混合型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。A类基金份额为在投资者认购、申购时收取认购、申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费，赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额；C类基金份额为在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，而在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、公

开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券（包括超短期融资券）以及法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、信用衍生品、股票期权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）。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。在未来条件许可的情况下，本基金可根据相关法律法规，在履行适当程序后，参与融券业务和转融通证券出借业务。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。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为60%-95%，其中，投资于本基金界定的“医药健康行业”相关股票资产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和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不得包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2024年6月30日及2023年12月31日的财务状况以及自2024年1月1日起至2024年6月30日和2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税

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

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

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

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

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

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

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（3）企业所得税

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

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

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

（4）个人所得税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	93,211.79
等于：本金	93,204.13
加：应计利息	7.66
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	93,211.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	11,206,467.01	-	10,679,662.48	-526,804.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	704,179.00	4,867.40	708,577.40	-469.00

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	704,179.00	4,867.40	708,577.40	-469.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		11,910,646.01	4,867.40	11,388,239.88	-527,273.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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

本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,863.02
合计	24,863.02

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 富荣医药健康混合发起A

金额单位：人民币元

项目 (富荣医药健康混合发起A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	15,390,427.74	15,390,427.74
本期申购	316,975.79	316,975.79
本期赎回(以“-”号填列)	-176,163.68	-176,163.68
本期末	15,531,239.85	15,531,239.85

6.4.7.6.2 富荣医药健康混合发起C

金额单位：人民币元

项目 (富荣医药健康混合发起C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	926,098.86	926,098.86
本期申购	294,939.86	294,939.86
本期赎回(以“-”号填列)	-284,074.17	-284,074.17
本期末	936,964.55	936,964.55

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 富荣医药健康混合发起A

单位：人民币元

项目 (富荣医药健康混合发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,926,943.98	-222,626.02	-2,149,570.00
本期期初	-1,926,943.98	-222,626.02	-2,149,570.00
本期利润	-1,755,287.42	-471,875.40	-2,227,162.82
本期基金份额交易产生的变动数	-23,354.82	-5,057.75	-28,412.57
其中:基金申购款	-62,821.60	-6,601.54	-69,423.14

基金赎回款	39,466.78	1,543.79	41,010.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,705,586.22	-699,559.17	-4,405,145.39

6.4.7.7.2 富荣医药健康混合发起C

单位：人民币元

项目 (富荣医药健康混合发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-120,687.83	-13,473.12	-134,160.95
本期期初	-120,687.83	-13,473.12	-134,160.95
本期利润	-104,858.22	-34,376.39	-139,234.61
本期基金份额交易产生的变动数	-3,537.99	5,799.22	2,261.23
其中：基金申购款	-64,122.86	1,696.61	-62,426.25
基金赎回款	60,584.87	4,102.61	64,687.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-229,084.04	-42,050.29	-271,134.33

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	171.11
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	-
其他	740.75
合计	911.86

注：其他为券商保证金利息收入。

6.4.7.9 股票投资收益

6.4.7.9.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	72,977,914.20
减：卖出股票成本总额	74,721,674.93
减：交易费用	158,684.58
买卖股票差价收入	-1,902,445.31

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	4,506.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-140.91
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	4,365.94

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-

减：交易费用	140.91
买卖债券差价收入	-140.91

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益/损失。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	151,285.53
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	151,285.53

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-506,251.79
——股票投资	-505,782.79
——债券投资	-469.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-506,251.79

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	878.46
转换费收入	38.90
合计	917.36

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 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	328.50
合计	25,191.52

6.4.7.18 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富荣基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券股份有限公司	112,958.63	100.00%	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	75,920.11	107,596.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,435.33	12,367.32
应支付基金管理人的净管理费	69,484.78	95,229.65

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	12,653.34	17,932.82

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣医药健康混合发起A	富荣医药健康混合发起C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	9.91	9.91
中信银行股份有限公司	0.00	16.57	16.57
合计	0.00	26.48	26.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣医药健康混合发起A	富荣医药健康混合发起C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	12.41	12.41
中信银行股份有限公司	0.00	20.58	20.58
合计	0.00	32.99	32.99

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H为每日C类基金份额应计提的销售服务费

E为前一日C类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

富荣医药健康混合发起A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
基金合同生效日（2022年06月28日）持有的基金份额	5,002,833.90	5,002,833.90
报告期初持有的基金份额	5,002,833.90	5,002,833.90
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,002,833.90	5,002,833.90
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	32.21%	35.65%

- 注：1、对于分类基金，比例的分母采用各自类别的总份额。
2、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	93,211.79	171.11	682,867.94	932.78

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生在承销期内参与关联方承销的证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期内及上年度可比期间内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无利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险控制委员会为核心的，由督察长、经理层、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；督察长独立行使督察权利，负责公司及其基金运作的监察稽核工作，直接对董事会负责；经理层下设投资决策委员会、风险管理委员会、IT治理委员会、产品委员会、专户业务评审委员会、自有资金投资决策委员会、估值委员会等，协助总经理对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了内部评级体系和交易对手库，对投资品种进行内部评级并分散化投资，对交易对手实行准入和分级管理，以控制相应的信用风险。

于2024年6月30日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券及资产支持证券。（2023年12月31日：本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券。）

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	708,577.40	-
合计	708,577.40	-

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

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 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	93,211.79	-	-	-	93,211.79

存出保证金	349,017.83	-	-	-	349,017.83
交易性金融资产	708,577.40	-	-	10,679,662.48	11,388,239.88
应收申购款	-	-	-	5,069.55	5,069.55
资产总计	1,150,807.02	-	-	10,684,732.03	11,835,539.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,423.98	4,423.98
应付管理人报酬	-	-	-	12,084.97	12,084.97
应付托管费	-	-	-	2,014.16	2,014.16
应付销售服务费	-	-	-	228.24	228.24
其他负债	-	-	-	24,863.02	24,863.02
负债总计	-	-	-	43,614.37	43,614.37
利率敏感度缺口	1,150,807.02	-	-	不适用	不适用
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	110,082.37	-	-	-	110,082.37
存出保证金	1,323,277.51	-	-	-	1,323,277.51

交易性金融资产	-	-	-	12,666,285.08	12,666,285.08
应收申购款	-	-	-	1,102.43	1,102.43
资产总计	1,433,359.88	-	-	12,667,387.51	14,100,747.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	820.53	820.53
应付管理人报酬	-	-	-	14,448.23	14,448.23
应付托管费	-	-	-	2,408.05	2,408.05
应付销售服务费	-	-	-	274.93	274.93
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	67,951.74	67,951.74
利率敏感度缺口	1,433,359.88	-	-	不适用	不适用

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年6月30日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值的6.01%，因此市场利率对于本基金资产净值无重大影响。（于2023年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率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 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	10,679,662.48	90.57	12,666,285.08	90.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	708,577.40	6.01	-	-
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	11,388,239.88	96.58	12,666,285.08	90.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。
----	---

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	663,104.50	728,823.99
	基金业绩比较基准下降5%	-663,104.50	-728,823.99

注：中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	10,679,662.48	12,666,285.08
第二层次	708,577.40	-
第三层次	-	-
合计	11,388,239.88	12,666,285.08

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调

整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

(2) 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

(3) 财务报表的批准

本财务报表已于2024年8月29日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,679,662.48	90.23
	其中：股票	10,679,662.48	90.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	708,577.40	5.99
	其中：债券	708,577.40	5.99
	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	93,211.79	0.79
8	其他各项资产	354,087.38	2.99
9	合计	11,835,539.05	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,807,373.80	74.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,538,864.68	13.05
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	333,424.00	2.83
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	10,679,662.48	90.57

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688117	圣诺生物	7,900	193,866.00	1.64
2	603301	振德医疗	8,900	185,654.00	1.57
3	300677	英科医疗	6,900	184,989.00	1.57
4	603439	贵州三力	14,300	182,468.00	1.55
5	688273	麦澜德	9,200	182,160.00	1.54
6	688338	赛科希德	8,400	181,860.00	1.54
7	688468	科美诊断	28,700	181,671.00	1.54
8	300406	九强生物	11,800	181,484.00	1.54
9	688506	百利天恒	1,000	181,400.00	1.54
10	603309	维力医疗	16,400	180,564.00	1.53
11	603987	康德莱	29,500	180,245.00	1.53
12	600529	山东药玻	7,100	179,914.00	1.53
13	688253	英诺特	4,700	179,117.00	1.52
14	603811	诚意药业	28,500	178,125.00	1.51
15	002020	京新药业	17,000	177,990.00	1.51
16	688566	吉贝尔	7,900	177,750.00	1.51
17	601607	上海医药	9,300	177,723.00	1.51
18	300463	迈克生物	15,600	177,528.00	1.51
19	688389	普门科技	10,900	177,234.00	1.50
20	600267	海正药业	25,200	176,904.00	1.50
21	688016	心脉医疗	1,800	176,490.00	1.50
22	603538	美诺华	15,800	176,486.00	1.50
23	000739	普洛药业	13,000	176,410.00	1.50
24	603387	基蛋生物	22,700	176,152.00	1.49
25	688580	伟思医疗	6,580	176,080.80	1.49
26	300109	新开源	15,200	176,016.00	1.49

27	600332	白云山	6,000	175,980.00	1.49
28	002422	科伦药业	5,800	175,914.00	1.49
29	600664	哈药股份	66,600	175,824.00	1.49
30	605369	拱东医疗	4,400	175,560.00	1.49
31	603658	安图生物	3,800	175,066.00	1.48
32	000915	华特达因	5,800	174,928.00	1.48
33	301367	怡和嘉业	2,800	174,160.00	1.48
34	300453	三鑫医疗	27,200	173,808.00	1.47
35	600535	天士力	13,800	173,604.00	1.47
36	000403	派林生物	6,500	173,290.00	1.47
37	600867	通化东宝	20,700	173,259.00	1.47
38	603368	柳药集团	9,900	173,250.00	1.47
39	688276	百克生物	6,100	173,057.00	1.47
40	002737	葵花药业	7,400	173,012.00	1.47
41	600211	西藏药业	5,300	172,674.00	1.46
42	600998	九州通	35,311	172,317.68	1.46
43	600062	华润双鹤	8,800	172,304.00	1.46
44	300841	康华生物	3,400	172,176.00	1.46
45	600327	大东方	53,800	172,160.00	1.46
46	002727	一心堂	11,400	172,026.00	1.46
47	000950	重药控股	35,300	171,911.00	1.46
48	603367	辰欣药业	12,300	171,462.00	1.45
49	688581	安杰思	3,500	171,255.00	1.45
50	600566	济川药业	5,400	171,234.00	1.45
51	688621	阳光诺和	4,000	170,800.00	1.45
51	300482	万孚生物	7,000	170,800.00	1.45
53	300003	乐普医疗	11,500	170,660.00	1.45
54	300622	博士眼镜	14,000	170,380.00	1.44
55	002001	新和成	8,800	168,960.00	1.43
56	603235	天新药业	7,000	168,210.00	1.43
57	600976	健民集团	3,300	166,650.00	1.41

58	600380	健康元	14,900	166,433.00	1.41
59	000661	长春高新	1,800	165,186.00	1.40
60	301096	百诚医药	2,800	162,624.00	1.38
61	605266	健之佳	6,260	162,447.00	1.38

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	300760	迈瑞医疗	2,290,546.00	16.32
2	603259	药明康德	1,673,062.00	11.92
3	688016	心脉医疗	910,410.80	6.49
4	000538	云南白药	855,371.80	6.10
5	600276	恒瑞医药	847,372.00	6.04
6	688338	赛科希德	829,800.92	5.91
7	688276	百克生物	826,944.64	5.89
8	600998	九州通	821,724.91	5.86
9	000403	派林生物	792,508.00	5.65
10	301033	迈普医学	768,820.00	5.48
11	605116	奥锐特	755,113.00	5.38
12	603520	司太立	740,458.00	5.28
13	002001	新和成	728,836.00	5.19
14	605266	健之佳	718,490.00	5.12
15	600211	西藏药业	713,241.00	5.08
16	688621	阳光诺和	706,401.86	5.03
17	000915	华特达因	683,680.00	4.87
18	688212	澳华内镜	678,617.23	4.84
19	600867	通化东宝	671,735.00	4.79
20	301301	川宁生物	668,537.00	4.76

21	688513	苑东生物	662,512.46	4.72
22	301096	百诚医药	658,872.00	4.70
23	688578	艾力斯	656,943.02	4.68
24	688198	佰仁医疗	651,954.40	4.65
25	603896	寿仙谷	648,060.45	4.62
26	600332	白云山	636,055.00	4.53
27	000661	长春高新	629,900.00	4.49
28	300396	迪瑞医疗	627,081.00	4.47
29	600196	复星医药	623,416.00	4.44
30	600079	人福医药	622,707.00	4.44
31	600511	国药股份	619,619.00	4.42
32	600535	天士力	607,782.00	4.33
33	688607	康众医疗	596,446.47	4.25
34	688050	爱博医疗	582,870.19	4.15
35	600380	健康元	573,731.00	4.09
36	603590	康辰药业	569,252.00	4.06
37	300896	爱美客	562,769.00	4.01
38	002737	葵花药业	561,296.00	4.00
39	300832	新产业	556,817.00	3.97
40	601607	上海医药	533,088.00	3.80
41	000423	东阿阿胶	527,956.00	3.76
42	688236	春立医疗	519,152.52	3.70
43	688520	神州细胞	505,375.74	3.60
44	688278	特宝生物	501,010.80	3.57
45	300143	盈康生命	494,227.00	3.52
46	600566	济川药业	486,195.00	3.46
47	000999	华润三九	474,831.00	3.38
48	300529	健帆生物	469,598.00	3.35
49	301207	华兰疫苗	466,304.00	3.32
50	002422	科伦药业	463,154.00	3.30
51	002223	鱼跃医疗	459,062.00	3.27

52	603087	甘李药业	457,230.00	3.26
53	301047	义翘神州	454,553.00	3.24
54	600587	新华医疗	451,237.00	3.22
55	600216	浙江医药	441,057.00	3.14
56	688626	翔宇医疗	437,496.30	3.12
57	688617	惠泰医疗	434,878.12	3.10
58	688393	安必平	431,850.06	3.08
59	300003	乐普医疗	430,750.00	3.07
60	688389	普门科技	429,425.97	3.06
61	600529	山东药玻	421,097.00	3.00
62	688366	昊海生科	411,876.91	2.94
63	688336	三生国健	410,238.40	2.92
64	605369	拱东医疗	398,921.00	2.84
65	300171	东富龙	398,319.00	2.84
66	688271	联影医疗	397,961.02	2.84
67	300453	三鑫医疗	397,188.00	2.83
68	002821	凯莱英	396,287.00	2.82
69	300705	九典制药	393,777.00	2.81
70	300406	九强生物	390,557.00	2.78
71	603811	诚意药业	390,544.00	2.78
72	688468	科美诊断	390,423.68	2.78
73	603233	大参林	388,840.00	2.77
74	603538	美诺华	388,003.00	2.76
75	600327	大东方	385,554.00	2.75
76	300109	新开源	379,821.00	2.71
77	002262	恩华药业	378,038.92	2.69
78	301333	诺思格	373,703.00	2.66
79	600750	江中药业	368,716.00	2.63
80	603658	安图生物	364,124.00	2.59
81	300558	贝达药业	357,247.00	2.55
82	603368	柳药集团	347,147.00	2.47

83	002603	以岭药业	341,863.00	2.44
84	002166	莱茵生物	339,374.00	2.42
85	603882	金域医学	336,380.00	2.40
86	688046	药康生物	335,969.41	2.39
87	000534	万泽股份	329,235.00	2.35
88	002880	卫光生物	325,537.00	2.32
89	300122	智飞生物	316,053.00	2.25
90	300573	兴齐眼药	311,508.00	2.22
91	688289	圣湘生物	309,927.59	2.21
92	688301	奕瑞科技	305,136.00	2.17
93	600062	华润双鹤	300,444.00	2.14
94	002020	京新药业	287,954.00	2.05
95	300009	安科生物	286,500.00	2.04
96	002294	信立泰	281,968.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	2,909,006.00	20.73
2	603259	药明康德	2,290,249.00	16.32
3	600276	恒瑞医药	1,700,462.00	12.12
4	000538	云南白药	1,045,368.00	7.45
5	301033	迈普医学	819,551.00	5.84
6	605116	奥锐特	813,111.00	5.79
7	600196	复星医药	782,981.00	5.58
8	301301	川宁生物	751,644.00	5.36
9	688016	心脉医疗	749,203.80	5.34
10	600079	人福医药	735,171.00	5.24

11	002001	新和成	716,373.00	5.10
12	603520	司太立	714,962.00	5.09
13	000403	派林生物	700,685.00	4.99
14	688338	赛科希德	691,798.39	4.93
15	600998	九州通	690,740.00	4.92
16	688513	苑东生物	677,809.78	4.83
17	688276	百克生物	670,741.41	4.78
18	300396	迪瑞医疗	669,679.00	4.77
19	300896	爱美客	665,643.00	4.74
20	600511	国药股份	664,682.00	4.74
21	000423	东阿阿胶	663,124.00	4.73
22	688578	艾力斯	656,874.87	4.68
23	688212	澳华内镜	645,767.86	4.60
24	000999	华润三九	630,112.00	4.49
25	002223	鱼跃医疗	625,761.00	4.46
26	300832	新产业	623,663.00	4.44
27	000661	长春高新	618,146.00	4.41
28	688050	爱博医疗	616,811.64	4.40
29	688198	佰仁医疗	606,210.36	4.32
30	300122	智飞生物	594,455.00	4.24
31	603590	康辰药业	593,902.00	4.23
32	603896	寿仙谷	587,421.00	4.19
33	688278	特宝生物	577,777.69	4.12
34	600332	白云山	558,048.00	3.98
35	603087	甘李药业	557,300.00	3.97
36	600436	片仔癀	556,460.00	3.97
37	688607	康众医疗	555,273.52	3.96
38	300015	爱尔眼科	545,975.00	3.89
39	688236	春立医疗	545,496.16	3.89
40	600867	通化东宝	544,727.00	3.88
41	688621	阳光诺和	529,607.47	3.77

42	600211	西藏药业	527,000.19	3.76
43	300529	健帆生物	517,650.00	3.69
44	605266	健之佳	517,135.10	3.69
45	002821	凯莱英	515,558.00	3.67
46	000915	华特达因	507,842.00	3.62
47	301207	华兰疫苗	498,389.00	3.55
48	300705	九典制药	494,870.00	3.53
49	688520	神州细胞	493,658.83	3.52
50	600587	新华医疗	483,895.00	3.45
51	002262	恩华药业	482,424.00	3.44
52	688393	安必平	481,851.58	3.43
53	600380	健康元	479,119.00	3.41
54	600535	天士力	478,062.00	3.41
55	301096	百诚医药	476,274.00	3.39
56	600216	浙江医药	473,000.00	3.37
57	603233	大参林	466,290.00	3.32
58	688617	惠泰医疗	463,947.00	3.31
59	601607	上海医药	456,813.00	3.26
60	688626	翔宇医疗	453,509.35	3.23
61	300143	盈康生命	451,502.00	3.22
62	002422	科伦药业	445,085.00	3.17
63	300171	东富龙	435,277.00	3.10
64	688336	三生国健	433,068.30	3.09
65	002603	以岭药业	424,311.00	3.02
66	301047	义翘神州	416,835.00	2.97
67	688271	联影医疗	414,032.00	2.95
68	300009	安科生物	409,933.00	2.92
69	600750	江中药业	405,824.00	2.89
70	688366	昊海生科	396,509.54	2.83
71	603882	金域医学	386,464.00	2.75
72	002737	葵花药业	382,521.00	2.73

73	002294	信立泰	379,412.00	2.70
74	600566	济川药业	374,202.00	2.67
75	002044	美年健康	370,352.00	2.64
76	688076	诺泰生物	357,609.07	2.55
77	300003	乐普医疗	357,529.00	2.55
78	002166	莱茵生物	355,989.00	2.54
79	300558	贝达药业	351,531.00	2.51
80	000513	丽珠集团	338,288.00	2.41
81	301333	诺思格	329,998.00	2.35
82	002007	华兰生物	328,941.00	2.34
83	002773	康弘药业	326,991.00	2.33
84	600529	山东药玻	326,951.00	2.33
85	688687	凯因科技	322,351.45	2.30
86	002880	卫光生物	321,695.00	2.29
87	300109	新开源	318,260.00	2.27
88	300595	欧普康视	314,777.00	2.24
89	600521	华海药业	313,046.00	2.23
90	603456	九洲药业	300,789.00	2.14
91	002653	海思科	300,744.00	2.14
92	300298	三诺生物	300,095.00	2.14
93	688301	奕瑞科技	294,896.20	2.10
94	300181	佐力药业	291,725.00	2.08
95	002432	九安医疗	285,600.00	2.04
96	002019	亿帆医药	285,553.00	2.03
97	301087	可孚医疗	285,243.00	2.03

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	73,240,835.12
卖出股票收入（成交）总额	72,977,914.20

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	708,577.40	6.01
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	708,577.40	6.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019698	23国债05	7,000	708,577.40	6.01

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，四川百利在报告编制日前一年内被上海证券交易所出具监管工作函。振德医疗在报告编制日前一年内被绍兴市越城区市场监督管理局警告、罚款及没收违法所得。

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	349,017.83
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,069.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	354,087.38

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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

58 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 医药 健康 混合 发起A	223	69,646.82	5,002,833.90	32.2114%	10,528,405.95	67.7886%
富荣 医药 健康 混合 发起C	233	4,021.31	0.00	0.00%	936,964.55	100.00%
合计	432	38,120.84	5,002,833.90	30.3787%	11,465,370.50	69.6213%

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	富荣医药健康混合发起A	5,174,558.04	33.32%
	富荣医药健康混合发起C	4,175.84	0.45%
	合计	5,178,733.88	31.45%

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	富荣医药健康混合发起A	>100
	富荣医药健康混合发起C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	富荣医药健康混合发起A	>100
	富荣医药健康混合发起C	0
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	5,002,833.90	30.38%	5,002,833.90	30.38%	3年
基金管理人高	2,000,472.60	12.15%	2,000,472.60	12.15%	3年

级管理人员					
基金经理等人员	3,091,173.77	18.77%	3,000,708.62	18.22%	3年
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	6,373,724.13	38.70%	0.00	0.00%	-
合计	16,468,204.40	100.00%	10,004,015.12	60.75%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣医药健康混合发起 A	富荣医药健康混合发起 C
基金合同生效日(2022年06月28日)基金份额总额	11,609,187.79	1,252,250.48
本报告期期初基金份额总额	15,390,427.74	926,098.86
本报告期基金总申购份额	316,975.79	294,939.86
减：本报告期基金总赎回份额	176,163.68	284,074.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,531,239.85	936,964.55

注：申购含转换入份额、红利再投份额；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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未出现变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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	
中信证券	4	146,218,749.32	100.00%	112,958.63	100.00%	-

(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。(4) 本基金管理人已于2024年7月1日根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及证券业协会测算结果完成佣金费率调整，相关证券公司选择标准和程序将按新规执行。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	704,179.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第4季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-22
2	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增华西证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-22
3	富荣基金管理有限公司关于董事变更的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-01
4	富荣基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20
5	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
6	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年年度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-30
7	富荣基金管理有限公司旗下	证券时报、基金管理人网站、	2024-04-22

	全部基金2024年第1季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站	
8	富荣基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金更新招募说明书及产品资料概要的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-07
9	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海云湾基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-18
10	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳腾元基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101 - 20240630	5,002,833.90	-	-	5,002,833.90	30.38%

产品特有风险

本报告期本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况，未来或存在如下风险，敬请投资者留意：
 （1）赎回申请延期办理的风险 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。（2）基金资产净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。（3）提前终止基金合同的风险 《基金合同》生效满3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，《基金合同》应当终止；《基金合同》生效满3年后继续存续的，连续60个

工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。（4）基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，基金投资可能面临一定困难。

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准富荣医药健康混合型发起式证券投资基金设立的文件；

12.1.2 《富荣医药健康混合型发起式证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《富荣医药健康混合型发起式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 报告期内富荣医药健康混合型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富荣基金管理有限公司，客服热线：4006855600。

富荣基金管理有限公司
二〇二四年八月三十一日