

# 富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 30 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。本年度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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月22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。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	15
§5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告.....	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 净资产变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
8.3 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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
8.6 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.....	61
8.7 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.....	61
8.8 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.....	61

8.9 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 .....	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	61
§9 基金份额持有人信息 .....	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
9.3 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.....	63
§10 开放式基金份额变动.....	63
§11 重大事件揭示.....	64
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
11.2 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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8 其他重大事件.....	66
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
12.1 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 .....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§13 备查文件目录.....	70
13.1 备查文件目录.....	70
13.2 存放地点 .....	70
13.3 查阅方式 .....	70

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	富荣福鑫混合	
基金主代码	004794	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月13日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,525,574.84份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣福鑫混合A	富荣福鑫混合C
下属分级基金的交易代码	004794	004795
报告期末下属分级基金的份额总额	1,179,200.53份	2,346,374.31份

## 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		富荣基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	任晓伟	潘琦
	联系电话	0755-84356633	0755-22168257
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-685-5600	95511-3
传真		0755-83230787	0755-82080387
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址		深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
邮政编码		518038	518001
法定代表人		王亦伟	谢永林

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.furamc.com.cn/">http://www.furamc.com.cn/</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023年	2022年	2021年
---------------	-------	-------	-------

	富荣福鑫 混合A	富荣福鑫 混合C	富荣福鑫 混合A	富荣福鑫混 合C	富荣福鑫 混合A	富荣福鑫 混合C
本期已实现收益	-221,330.23	-787,152.32	-308,028.37	-1,710,672.17	5,269,536.15	2,791,399.44
本期利润	-207,512.63	-800,666.37	-313,567.11	-2,057,185.66	1,412,186.97	822,298.17
加权平均基金份额本 期利润	-0.1647	-0.1680	-0.4780	-0.4595	0.2641	0.1852
本期加权平均净值利 润率	-17.73%	-18.01%	-41.76%	-38.63%	19.69%	13.93%
本期基金份额净值增 长率	-16.50%	-16.59%	-31.61%	-31.66%	13.15%	13.34%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	-209,158.30	-417,532.27	-17,237.28	-64,765.68	141,901.69	2,017,878.46
期末可供分配基金份 额利润	-0.1774	-0.1779	-0.0148	-0.0144	0.4405	0.4423
期末基金资产净值	970,042.23	1,928,842.04	1,150,409.78	4,439,819.44	464,065.25	6,579,829.47
期末基金份额净值	0.8226	0.8221	0.9852	0.9856	1.4405	1.4423
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增 长率	-9.39%	-9.45%	8.52%	8.56%	58.68%	58.87%

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

③期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富荣福鑫混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-2.42%	1.34%	-1.13%	0.24%	-1.29%	1.10%
过去六个月	-14.11%	1.16%	-1.77%	0.25%	-12.34%	0.91%
过去一年	-16.50%	1.08%	0.13%	0.25%	-16.63%	0.83%
过去三年	-35.39%	1.45%	-1.74%	0.33%	-33.65%	1.12%
过去五年	-8.63%	1.22%	23.56%	0.36%	-32.19%	0.86%
自基金合同生效起至今	-9.39%	1.13%	21.37%	0.36%	-30.76%	0.77%

## 富荣福鑫混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.44%	1.34%	-1.13%	0.24%	-1.31%	1.10%
过去六个月	-14.15%	1.16%	-1.77%	0.25%	-12.38%	0.91%
过去一年	-16.59%	1.08%	0.13%	0.25%	-16.72%	0.83%
过去三年	-35.39%	1.45%	-1.74%	0.33%	-33.65%	1.12%
过去五年	-8.49%	1.22%	23.56%	0.36%	-32.05%	0.86%
自基金合同生效起至今	-9.45%	1.13%	21.37%	0.36%	-30.82%	0.77%

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

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

富荣福鑫混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年02月13日-2023年12月31日)

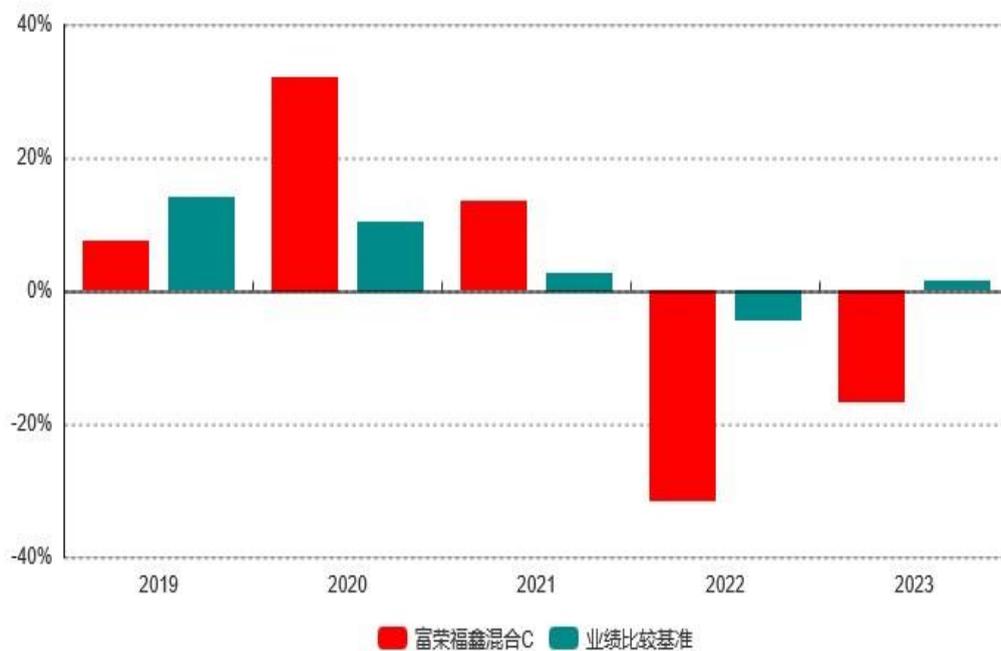
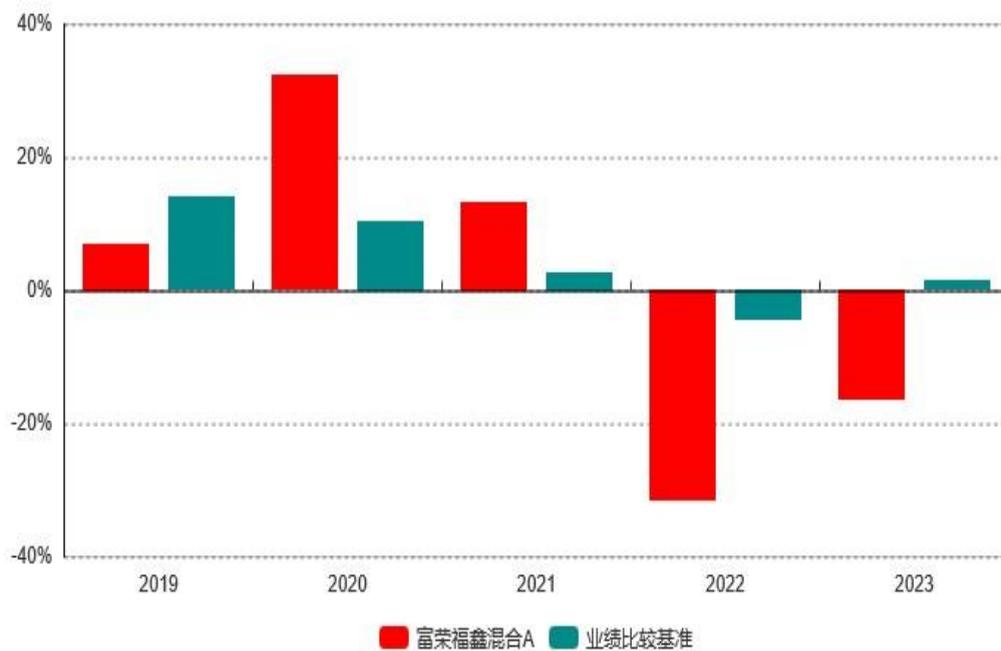


富荣福鑫混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年02月13日-2023年12月31日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

截止2023年12月31日止，本基金过去三年未进行利润分配。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

## 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓宇翔	权益投资部总经理、基金经理	2018-03-30	-	17	硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任西南证券股份有限公司资深投资经理、深圳东新佳投资有限公司投资经理。2017年2月22日加入富荣基金。
王丹	固定收益部总经理助理、基金经理	2020-05-12	-	12	北京大学工商管理硕士，厦门大学理学学士，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任寰富投资咨询上海有限公司金融衍生品交易员，长盛基金管理有限公司债券交易员，嘉实基金管理有限公司投资经理，华融证券股份有限公司固收研究、交易主管。2019年6月21日加

					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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了公司内部的公平交易制度。该制度所规范的范围涵盖旗下各类投资组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公司通过建立科学的投资决策机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和信息技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.3 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

报告期内，本基金继续秉持价值投资的理念，坚持以宏观视角自上而下的选定行业配比为基准，结合企业长期估值和中短期的成长性，自下而上配置个股权重，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

2023年的市场“一波三折”，总体分为四个阶段，阶段一--开年“春季躁动”（1月）。彼时的市场对疫后复苏有较高预期，市场情绪回暖，大盘成长风格占据主导地位，2022年0月份回弹力度较弱的行业在年初都开启了显著的补涨行情，行业接替修复，轮动速度加快；阶段二--AIGC“横空出世”（2-4月）。技术创新带来科技、传媒的板块效应。此外，2022年11月提出的“探索建立具有中国特色的估值体系”带动央企估值重新进入上升通道；5-7月，市场进入阶段性横盘期；阶段三--强预期与弱现实（8-9月）。在7月份中央政治局会议提出的“活跃资本市场”的背景下，市场预期升温。然而8月份开始，北向资金持续大幅净流出，加之国内一系列政策预期走弱，“强预期”最终未能战胜“弱现实”，大盘开始回调，减肥药、华为链等热门主题涌现；阶段四--反弹行情未能延续，市场持续下跌（10-12月）。10月份初期市场维持下行趋势，月底救市政策频出（汇金增持四大行、万亿国债、股份回购等）提振投资者信心，10月底至11月底市场迎来了年内的第二波行情。然而，三季度大部分企业盈利低于预期，加上四季度公布的宏观经济数据显示经济增速放缓，市场情绪急转直下，下跌行情直至年末。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣福鑫混合A基金份额净值为0.8226元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.50%，同期业绩比较基准收益率为0.13%；截至报告期末富荣福鑫混合C基金份额净值为0.8221元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-16.59%，同期业绩比较基准收益率为0.13%。

#### 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年全年GDP增速5.2%，超过目标值5.0%，我国经济仍然处于稳步上升的通道中，虽然当前处于产业转型的阵痛期，但是2023年7月份中央政治局经济会议已经确立了“政策底”，当前的市场正处于从“政策底”到“市场底”的预期扭转阶段。我们有理由相信，在我国经济稳步向上的背景下，我国股市的估值有望企稳回升。

展望2024，短期内市场大概率难以走出存量博弈阶段，反转策略或优于动量策略；市场风格上，美联储加息步伐逐渐进入尾声，海外流动性有望上升，同时带动A股风险偏好回升。从历史统计规律上看，美债短端利率与A股成长风格显著负相关，因此在成长风格的制约因素减少，利好因素增加的情况下，其相对其他风格占优的概率较大。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人依据法律法规、监管政策的变化,并结合公司业务发展情况,遵照公司内部控制的整体要求,不断完善内控建设,积极践行合规风控管理,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规政策和公司管理制度的落实,确保基金合同得到严格履行。

报告期内,本基金管理人积极贯彻落实新的监管要求,及时进行公司制度、流程的制定和修订,进一步完善公司的内控体系;全面参与各类新产品、新业务的合规风险评估及相关控制措施的研究与落实,确保各项业务的合规开展;实行入职合规宣导机制并组织开展合规培训,不断提高从业人员的合规素质;实时监控投资组合交易,监督投资运作的合规性;定期开展专项稽核工作,保障业务开展的合规有效性。

本基金管理人将继续坚持审慎勤勉的原则管理和运用基金资产,积极健全内部管理制度,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,加强防范各种风险,切实保护基金资产的安全及基金份额持有人的权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

本基金的基金合同于2018年2月13日生效，截止2023年12月31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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人已向证监会报备，并持续营销。本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

### §6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第70036562_H09号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们

	无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致</p>

	<p>对富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高鹤、黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
审计报告日期	2024-03-29

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	258,092.69	1,461,961.47
结算备付金		67,329.56	89,526.83
存出保证金		4,975.30	8,886.33

交易性金融资产	7.4.7.2	2,464,587.00	3,820,930.67
其中：股票投资		2,464,587.00	3,820,930.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		143,150.19	241,755.02
应收股利		-	-
应收申购款		300.00	1,522.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,938,434.74	5,624,582.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		15,612.47	3,849.25
应付赎回款		129.20	340.28
应付管理人报酬		1,997.04	2,916.78
应付托管费		332.85	486.16
应付销售服务费		246.13	387.77
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	7.4.7.6	21,232.78	26,373.25
负债合计		39,550.47	34,353.49
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	3,525,574.84	5,672,232.18
未分配利润	7.4.7.8	-626,690.57	-82,002.96
净资产合计		2,898,884.27	5,590,229.22
负债和净资产总计		2,938,434.74	5,624,582.71

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额总额3,525,574.84份，其中，下属A类基金份额净值0.8226元，基金份额总额1,179,200.53份；下属C类基金份额净值0.8221元，基金份额总额2,346,374.31份。

## 7.2 利润表

会计主体：富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-872,420.49	-2,335,675.73
1.利息收入		5,109.06	4,569.64
其中：存款利息收入	7.4.7.9	5,109.06	4,073.44
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		-	496.20
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		-899,255.74	-1,998,296.35
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-948,255.37	-2,114,000.90
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.11	2,303.74	23,232.20
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	46,695.89	92,472.35
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	303.55	-352,052.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	21,422.64	10,103.21
<b>减：二、营业总支出</b>		135,758.51	35,077.04
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	34,297.32	36,465.10
2.托管费	7.4.10.2.2	5,716.26	6,077.48
3.销售服务费	7.4.10.2.3	4,544.93	5,333.38
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	7.4.7.16	-	-
7.税金及附加		-	1.08
8.其他费用	7.4.7.17	91,200.00	-12,800.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,008,179.00	-2,370,752.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,008,179.00	-2,370,752.77
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,008,179.00	-2,370,752.77

### 7.3 净资产变动表

会计主体：富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,672,232.18	-82,002.96	5,590,229.22
二、本期期初净资产	5,672,232.18	-82,002.96	5,590,229.22
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-2,146,657.34	-544,687.61	-2,691,344.95
(一)、综合收益总额	-	-1,008,179.00	-1,008,179.00
(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)	-2,146,657.34	463,491.39	-1,683,165.95
其中：1.基金申购款	5,989,592.61	61,112.40	6,050,705.01
2.基金赎回款	-8,136,249.95	402,378.99	-7,733,870.96
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	3,525,574.84	-626,690.57	2,898,884.27
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,884,114.57	2,159,780.15	7,043,894.72

二、本期期初净资产	4,884,114.57	2,159,780.15	7,043,894.72
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	788,117.61	-2,241,783.11	-1,453,665.50
(一)、综合收益总额	-	-2,370,752.77	-2,370,752.77
(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)	788,117.61	128,969.66	917,087.27
其中: 1.基金申购款	2,465,859.24	503,308.00	2,969,167.24
2.基金赎回款	-1,677,741.63	-374,338.34	-2,052,079.97
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	5,672,232.18	-82,002.96	5,590,229.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]700号文《关于准予富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人富荣基金管理有限公司向社会公开发行人募集,基金合同于2018年2月13日正式生效,首次设立募集规模为203,287,218.01份基金份额。本基金为契约型开放式基金。本基金管理人为富荣基金管理有限公司,登记机构为富荣基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司

（以下简称“平安银行”）。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证，债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、地方政府债、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、货币市场工具（含同业存单等）、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证投资占基金资产净值的0-3%。

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

#### 7.4.2 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2号《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。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1）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；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	258,092.69	1,461,961.47
等于：本金	258,033.48	1,461,785.87
加：应计利息	59.21	175.60
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	258,092.69	1,461,961.47

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,535,496.00	-	2,464,587.00	-70,909.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,535,496.00	-	2,464,587.00	-70,909.00
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,892,143.22	-	3,820,930.67	-71,212.55

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,892,143.22	-	3,820,930.67	-71,212.55

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末均无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 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及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

无。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31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	12,232.78	26,373.25
其中：交易所市场	12,232.78	26,373.25

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	9,000.00	-
合计	21,232.78	26,373.25

### 7.4.7.7 实收基金

#### 7.4.7.7.1 富荣福鑫混合A

金额单位：人民币元

项目 (富荣福鑫混合A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,167,647.06	1,167,647.06
本期申购	300,446.90	300,446.90
本期赎回（以“-”号填列）	-288,893.43	-288,893.43
本期末	1,179,200.53	1,179,200.53

#### 7.4.7.7.2 富荣福鑫混合C

金额单位：人民币元

项目 (富荣福鑫混合C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,504,585.12	4,504,585.12
本期申购	5,689,145.71	5,689,145.71
本期赎回（以“-”号填列）	-7,847,356.52	-7,847,356.52
本期末	2,346,374.31	2,346,374.31

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。

### 7.4.7.8 未分配利润

#### 7.4.7.8.1 富荣福鑫混合A

单位：人民币元

项目 (富荣福鑫混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	443,701.16	-460,938.44	-17,237.28
本期期初	443,701.16	-460,938.44	-17,237.28
本期利润	-221,330.23	13,817.60	-207,512.63
本期基金份额交易产生的变动数	15,664.57	-72.96	15,591.61
其中：基金申购款	106,922.95	-110,422.47	-3,499.52
基金赎回款	-91,258.38	110,349.51	19,091.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	238,035.50	-447,193.80	-209,158.30

#### 7.4.7.8.2 富荣福鑫混合C

单位：人民币元

项目 (富荣福鑫混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,715,019.78	-1,779,785.46	-64,765.68
本期期初	1,715,019.78	-1,779,785.46	-64,765.68
本期利润	-787,152.32	-13,514.05	-800,666.37
本期基金份额交易产生的变动数	-454,814.21	902,713.99	447,899.78
其中：基金申购款	2,111,932.17	-2,047,320.25	64,611.92
基金赎回款	-2,566,746.38	2,950,034.24	383,287.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	473,053.25	-890,585.52	-417,532.27

#### 7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	3,849.54	2,803.79
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	1,142.23	1,167.62
其他	117.29	102.03
合计	5,109.06	4,073.44

注：其他为交易保证金利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	29,284,375.65	35,449,977.86
减：卖出股票成本总额	30,148,094.09	37,458,803.05
减：交易费用	84,536.93	105,175.71
买卖股票差价收入	-948,255.37	-2,114,000.90

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	2.94	297.98
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	2,300.80	22,934.22
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	2,303.74	23,232.20

## 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,304.40	106,437.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,000.00	78,192.87
减：应计利息总额	2.95	5,308.62
减：交易费用	0.65	1.84
买卖债券差价收入	2,300.80	22,934.22

## 7.4.7.12 衍生工具收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无衍生工具产生的投资收益/损失。

## 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	46,695.89	92,472.35
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	46,695.89	92,472.35

## 7.4.7.14 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12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
------	-----------------------------------	--

1.交易性金融资产	303.55	-352,052.23
——股票投资	303.55	-335,235.10
——债券投资	-	-16,817.13
——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	303.55	-352,052.23

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	21,422.15	10,026.37
基金转换费收入	0.49	76.84
合计	21,422.64	10,103.21

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，就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。

#### 7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无信用减值损失。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	-	-
信息披露费	-	-50,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	45,000.00	36,000.00
查询费	1,200.00	1,200.00
律师费	35,000.00	-
公证费	10,000.00	-
合计	91,200.00	-12,800.00

#### 7.4.7.18 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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

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
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人的股东
深圳嘉年实业股份有限公司	基金管理人的股东
湖南典勤投资开发有限公司	基金管理人的股东

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。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**7.4.10.1.5 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。

**7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	34,297.32	36,465.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,169.66	3,652.27
应支付基金管理人的净管理费	29,127.66	32,812.83

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为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,716.26	6,077.48

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0.10%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

#### 7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福鑫混合A	富荣福鑫混合C	合计
平安银行股份有限公司	0.00	25.75	25.75
富荣基金管理有限公司	0.00	3,804.79	3,804.79
合计	0.00	3,830.54	3,830.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福鑫混合A	富荣福鑫混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	4,705.03	4,705.03
平安银行股份有限公司	0.00	33.01	33.01
合计	0.00	4,738.04	4,738.04

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0.10%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

富荣福鑫混合C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	3,950,147.68	3,950,147.68
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	2,430,000.00	-
报告期末持有的基金份额	1,520,147.68	3,950,147.68
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	64.79%	87.69%

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

#### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年12月31日		2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	258,092.69	3,849.54	1,461,961.47	2,803.79

注：本基金的活期银行存款由基金托管人平安银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.12.4 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

### 7.4.13.2 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。（2022年12月31日：同）

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 按长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长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	258,092.69	-	-	-	258,092.69
结算备付金	67,329.56	-	-	-	67,329.56
存出保证金	4,975.30	-	-	-	4,975.30
交易性金融资产	-	-	-	2,464,587.00	2,464,587.00
应收清算款	-	-	-	143,150.19	143,150.19
应收申购款	-	-	-	300.00	300.00
资产总计	330,397.55	-	-	2,608,037.19	2,938,434.74
负债					
应付清算款	-	-	-	15,612.47	15,612.47
应付赎回款	-	-	-	129.20	129.20
应付管理人报酬	-	-	-	1,997.04	1,997.04
应付托管费	-	-	-	332.85	332.85

应付销售服务费	-	-	-	246.13	246.13
其他负债	-	-	-	21,232.78	21,232.78
负债总计	-	-	-	39,550.47	39,550.47
利率敏感度缺口	330,397.55	-	-	不适用	不适用
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,461,961.47	-	-	-	1,461,961.47
结算备付金	89,526.83	-	-	-	89,526.83
存出保证金	8,886.33	-	-	-	8,886.33
交易性金融资产	-	-	-	3,820,930.67	3,820,930.67
应收清算款	-	-	-	241,755.02	241,755.02
应收申购款	-	-	-	1,522.39	1,522.39
资产总计	1,560,374.63	-	-	4,064,208.08	5,624,582.71
负债					
应付清算款	-	-	-	3,849.25	3,849.25
应付赎回款	-	-	-	340.28	340.28
应付管理人报酬	-	-	-	2,916.78	2,916.78
应付托管费	-	-	-	486.16	486.16
应付销售服务费	-	-	-	387.77	387.77
其他负债	-	-	-	26,373.25	26,373.25
负债总计	-	-	-	34,353.49	34,353.49
利率敏感度缺口	1,560,374.63	-	-	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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年12月31日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2022年12月31日：同）

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	2,464,587.00	85.02	3,820,930.67	68.35
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产— 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,464,587.00	85.02	3,820,930.67	68.35

#### 7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	355,144.92	738,002.01
	基金业绩比较基准下降5%	-355,144.92	-738,002.01

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

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	2,464,587.00	3,737,392.67
第二层次	-	83,538.00
第三层次	-	-
合计	2,464,587.00	3,820,930.67

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期内未发生第三层次公允价值转入（转出）的情况。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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，本基金的资产净值为人民币2,898,884.27元，已连续超过六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。本基金管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。

除上述事项外，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3月29日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	2,464,587.00	83.87
	其中：股票	2,464,587.00	83.87
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	325,422.25	11.07
8	其他各项资产	148,425.49	5.05
9	合计	2,938,434.74	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	240,626.00	8.30
C	制造业	1,512,659.00	52.18
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	-	-
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	647,207.00	22.33
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	64,095.00	2.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,464,587.00	85.02

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 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	688311	盟升电子	3,000	153,030.00	5.28
2	300049	福瑞股份	2,800	122,052.00	4.21
3	300031	宝通科技	6,400	118,656.00	4.09
4	300036	超图软件	5,600	117,040.00	4.04
5	300130	新国都	4,800	116,160.00	4.01
6	601069	西部黄金	9,400	113,364.00	3.91
7	600256	广汇能源	15,500	110,670.00	3.82
8	300567	精测电子	1,200	105,144.00	3.63
9	300779	惠城环保	2,000	103,200.00	3.56
10	001309	德明利	1,000	94,890.00	3.27
11	002558	巨人网络	8,500	94,690.00	3.27
12	300257	开山股份	6,000	94,560.00	3.26
13	002517	恺英网络	7,500	83,775.00	2.89
14	300226	上海钢联	2,700	76,923.00	2.65
15	603666	亿嘉和	2,400	75,336.00	2.60
16	002215	诺普信	9,000	74,340.00	2.56
17	300337	银邦股份	8,000	64,720.00	2.23

18	300280	紫天科技	1,500	64,095.00	2.21
19	688525	佰维存储	1,000	62,660.00	2.16
20	688322	奥比中光	1,600	60,128.00	2.07
21	300857	协创数据	1,000	52,990.00	1.83
22	002755	奥赛康	4,700	50,854.00	1.75
23	002947	恒铭达	1,500	48,270.00	1.67
24	002929	润建股份	1,100	45,903.00	1.58
25	300418	昆仑万维	1,200	44,880.00	1.55
26	300406	九强生物	2,000	38,200.00	1.32
27	002555	三七互娱	2,000	37,620.00	1.30
28	300122	智飞生物	600	36,666.00	1.26
29	002001	新和成	2,100	35,616.00	1.23
30	300580	贝斯特	1,000	30,280.00	1.04
31	301236	软通动力	600	27,720.00	0.96
32	002371	北方华创	100	24,571.00	0.85
33	300308	中际旭创	200	22,582.00	0.78
34	300042	朗科科技	600	21,000.00	0.72
35	600348	华阳股份	1,700	16,592.00	0.57
36	605555	德昌股份	600	13,710.00	0.47
37	603667	五洲新春	500	11,700.00	0.40

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	300122	智飞生物	353,668.66	6.33
2	600383	金地集团	329,062.00	5.89
3	002605	姚记科技	306,772.00	5.49
4	300226	上海钢联	305,289.00	5.46

5	002555	三七互娱	298,068.00	5.33
6	300031	宝通科技	294,657.00	5.27
7	002517	恺英网络	294,386.00	5.27
8	300280	紫天科技	279,965.00	5.01
9	300130	新国都	276,927.00	4.95
10	300049	福瑞股份	276,399.00	4.94
11	300418	昆仑万维	271,468.00	4.86
12	300567	精测电子	266,886.00	4.77
13	601021	春秋航空	261,281.00	4.67
14	001309	德明利	253,068.00	4.53
15	688525	佰维存储	246,014.00	4.40
16	600765	中航重机	244,641.00	4.38
17	688766	普冉股份	243,099.78	4.35
18	688599	天合光能	238,596.56	4.27
19	600998	九州通	237,935.55	4.26
20	600809	山西汾酒	236,261.00	4.23
21	300036	超图软件	233,449.00	4.18
22	603859	能科科技	225,625.00	4.04
23	688008	澜起科技	223,041.00	3.99
24	300496	中科创达	207,571.00	3.71
25	688110	东芯股份	203,284.81	3.64
26	603081	大丰实业	202,508.00	3.62
27	688037	芯源微	201,954.00	3.61
28	688012	中微公司	197,929.26	3.54
29	688039	当虹科技	195,726.43	3.50
30	605168	三人行	189,038.00	3.38
31	002558	巨人网络	188,616.00	3.37
32	603599	广信股份	187,783.00	3.36
33	601800	中国交建	187,513.00	3.35
34	603690	至纯科技	183,396.00	3.28
35	000034	神州数码	182,780.00	3.27

36	300451	创业慧康	182,485.00	3.26
37	688365	光云科技	181,931.81	3.25
38	300490	华自科技	179,519.00	3.21
39	600460	士兰微	177,550.00	3.18
40	002236	大华股份	176,512.00	3.16
41	002987	京北方	174,768.00	3.13
42	688320	禾川科技	172,645.90	3.09
43	600633	浙数文化	171,472.00	3.07
44	002384	东山精密	169,928.00	3.04
45	300525	博思软件	169,673.00	3.04
46	300133	华策影视	169,347.00	3.03
47	002738	中矿资源	169,126.00	3.03
48	300083	创世纪	169,094.00	3.02
49	002913	奥士康	167,682.00	3.00
50	300428	立中集团	167,622.00	3.00
51	605333	沪光股份	167,062.00	2.99
52	300413	芒果超媒	166,537.00	2.98
53	000988	华工科技	160,192.00	2.87
54	688697	纽威数控	159,524.46	2.85
55	300314	戴维医疗	159,467.00	2.85
56	600859	王府井	158,435.64	2.83
57	000021	深科技	157,977.00	2.83
58	002624	完美世界	155,328.00	2.78
59	688569	铁科轨道	154,354.10	2.76
60	300232	洲明科技	152,936.00	2.74
61	688175	高凌信息	152,820.00	2.73
62	688311	盟升电子	152,666.00	2.73
63	688498	源杰科技	151,000.00	2.70
64	603267	鸿远电子	149,918.00	2.68
65	600664	哈药股份	147,195.00	2.63
66	688378	奥来德	146,517.91	2.62

67	003021	兆威机电	145,158.00	2.60
68	603170	宝立食品	143,084.00	2.56
69	300779	惠城环保	142,110.00	2.54
70	603939	益丰药房	141,924.00	2.54
71	003029	吉大正元	140,318.00	2.51
72	002174	游族网络	139,487.00	2.50
73	300738	奥飞数据	138,955.00	2.49
74	603208	江山欧派	136,393.00	2.44
75	601069	西部黄金	135,219.00	2.42
76	603986	兆易创新	133,978.00	2.40
77	600150	中国船舶	133,685.00	2.39
78	002654	万润科技	132,963.00	2.38
79	300638	广和通	132,040.50	2.36
80	688596	正帆科技	130,771.30	2.34
81	600958	东方证券	129,190.00	2.31
82	603811	诚意药业	128,482.00	2.30
83	000733	振华科技	128,278.00	2.29
84	002755	奥赛康	126,899.00	2.27
85	000686	东北证券	126,377.00	2.26
86	603277	银都股份	125,835.00	2.25
87	300002	神州泰岳	123,157.00	2.20
88	603667	五洲新春	122,802.00	2.20
89	300308	中际旭创	122,480.00	2.19
90	600409	三友化工	121,830.00	2.18
91	600256	广汇能源	119,975.00	2.15
92	002315	焦点科技	116,538.00	2.08
93	300613	富瀚微	115,806.00	2.07
94	688169	石头科技	114,886.80	2.06
95	300475	香农芯创	114,398.00	2.05
96	600141	兴发集团	114,368.00	2.05

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。

## 8.4.2 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	002605	姚记科技	355,171.00	6.35
2	300122	智飞生物	319,180.00	5.71
3	688121	卓然股份	304,732.13	5.45
4	600383	金地集团	290,636.00	5.20
5	300280	紫天科技	276,818.00	4.95
6	603369	今世缘	260,600.00	4.66
7	600998	九州通	248,150.00	4.44
8	688569	铁科轨道	240,772.12	4.31
9	688012	中微公司	239,258.00	4.28
10	300226	上海钢联	236,384.00	4.23
11	601021	春秋航空	231,460.00	4.14
12	688766	普冉股份	230,448.00	4.12
13	000002	万科A	227,320.00	4.07
14	300274	阳光电源	224,781.00	4.02
15	688008	澜起科技	223,520.00	4.00
16	688556	高测股份	222,502.42	3.98
17	600036	招商银行	222,490.00	3.98
18	002555	三七互娱	218,484.00	3.91
19	688110	东芯股份	215,395.00	3.85
20	688599	天合光能	210,897.95	3.77
21	688223	晶科能源	210,816.61	3.77
22	603198	迎驾贡酒	209,725.00	3.75
23	603081	大丰实业	209,576.00	3.75
24	000988	华工科技	208,374.00	3.73
25	300776	帝尔激光	205,370.00	3.67

26	605333	沪光股份	199,056.00	3.56
27	300418	昆仑万维	198,895.00	3.56
28	688039	当虹科技	198,702.00	3.55
29	600765	中航重机	198,113.00	3.54
30	600809	山西汾酒	197,992.00	3.54
31	688365	光云科技	196,675.76	3.52
32	603690	至纯科技	191,190.00	3.42
33	603859	能科科技	190,885.00	3.41
34	600460	士兰微	190,391.00	3.41
35	688037	芯源微	189,345.78	3.39
36	300049	福瑞股份	188,286.00	3.37
37	600633	浙数文化	187,042.00	3.35
38	000034	神州数码	185,652.00	3.32
39	000799	酒鬼酒	184,290.00	3.30
40	300232	洲明科技	182,855.00	3.27
41	002987	京北方	182,265.00	3.26
42	300314	戴维医疗	178,020.00	3.18
43	002517	恺英网络	177,705.00	3.18
44	002913	奥士康	177,640.00	3.18
45	600519	贵州茅台	176,578.00	3.16
46	688017	绿的谐波	176,491.03	3.16
47	600926	杭州银行	176,220.00	3.15
48	688525	佰维存储	175,829.00	3.15
49	688378	奥来德	172,568.90	3.09
50	001309	德明利	171,824.20	3.07
51	300525	博思软件	171,610.00	3.07
52	688697	纽威数控	168,657.50	3.02
53	300031	宝通科技	167,630.00	3.00
54	000568	泸州老窖	166,209.00	2.97
55	300629	新劲刚	162,062.00	2.90
56	601800	中国交建	161,344.00	2.89

57	300490	华自科技	161,342.00	2.89
58	300496	中科创达	160,304.00	2.87
59	002654	万润科技	159,564.00	2.85
60	002236	大华股份	159,540.00	2.85
61	300130	新国都	155,906.00	2.79
62	600664	哈药股份	153,180.00	2.74
63	300146	汤臣倍健	150,735.00	2.70
64	002315	焦点科技	148,298.00	2.65
65	002384	东山精密	148,238.00	2.65
66	605168	三人行	148,208.80	2.65
67	003021	兆威机电	147,318.00	2.64
68	300083	创世纪	145,920.00	2.61
69	688320	禾川科技	144,966.73	2.59
70	603170	宝立食品	144,250.00	2.58
71	002738	中矿资源	144,081.40	2.58
72	603667	五洲新春	143,549.00	2.57
73	300413	芒果超媒	142,031.00	2.54
74	600988	赤峰黄金	141,123.00	2.52
75	603277	银都股份	140,542.00	2.51
76	300133	华策影视	140,275.00	2.51
77	600325	华发股份	139,280.00	2.49
78	600859	王府井	138,982.00	2.49
79	688596	正帆科技	138,605.00	2.48
80	603599	广信股份	138,493.80	2.48
81	688498	源杰科技	138,012.00	2.47
82	300638	广和通	136,980.00	2.45
83	000021	深科技	136,458.00	2.44
84	300451	创业慧康	136,065.00	2.43
85	603927	中科软	130,186.00	2.33
86	603267	鸿远电子	126,179.00	2.26
87	603986	兆易创新	125,488.00	2.24

88	688789	宏华数科	125,391.68	2.24
89	600409	三友化工	125,325.00	2.24
90	300002	神州泰岳	124,875.00	2.23
91	600150	中国船舶	123,634.00	2.21
92	300212	易华录	123,104.00	2.20
93	300857	协创数据	123,085.00	2.20
94	603939	益丰药房	122,459.00	2.19
95	300428	立中集团	121,042.00	2.17
96	300567	精测电子	120,335.00	2.15
97	300738	奥飞数据	119,830.00	2.14
98	688175	高凌信息	118,581.31	2.12
99	000650	仁和药业	117,738.00	2.11
100	603368	柳药集团	117,705.00	2.11
101	300613	富瀚微	117,180.00	2.10
102	003029	吉大正元	116,761.00	2.09
103	002624	完美世界	115,948.00	2.07
104	688169	石头科技	115,428.24	2.06
105	000686	东北证券	115,126.00	2.06
106	300036	超图软件	113,962.00	2.04
107	600958	东方证券	113,620.00	2.03
108	601877	正泰电器	113,400.00	2.03
109	600475	华光环能	113,270.00	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。

#### 8.4.3 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	28,791,446.87
卖出股票收入（成交）总额	29,284,375.65

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，德明利在报告编制日前一年内因未依法履行其他职责及特定重大事项披露违规被中国证券监督管理委员会及深圳证券交易所分别出具警示函和监管函。

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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	4,975.30
2	应收清算款	143,150.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,425.49

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 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存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
富荣福鑫混合A	360	3,275.56	81.77	0.0069%	1,179,118.76	99.9931%
富荣福鑫混合C	375	6,257.00	1,520,147.68	64.7871%	826,226.63	35.2129%
合计	679	5,192.30	1,520,229.45	43.12%	2,005,345.39	56.88%

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。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份 额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	富荣福鑫混合A	330.81	0.03%
	富荣福鑫混合C	-	-
	合计	330.81	0.01%

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）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数 量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	富荣福鑫混合A	0
	富荣福鑫混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富荣福鑫混合A	0
	富荣福鑫混合C	0
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣福鑫混合A	富荣福鑫混合C
基金合同生效日(2018年02月13 日)基金份额总额	2,267,773.57	201,019,444.44
本报告期期初基金份额总额	1,167,647.06	4,504,585.12
本报告期基金总申购份额	300,446.90	5,689,145.71

减：本报告期基金总赎回份额	288,893.43	7,847,356.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,179,200.53	2,346,374.31

注：申购含转换入份额、红利再投份额；赎回含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

1、基金管理人以通讯方式组织召开了富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，会议投票时间自2023年4月1日起，至2023年4月26日17:00止，并于2023年4月27日审议通过了《关于富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》，本基金持续运作，运作方式不发生改变，并继续现有投资策略，推进平稳运作。上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

2、基金管理人以通讯方式组织召开了富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，会议投票时间自2023年12月22日起，至2024年1月21日17:00止，并于2024年1月22日审议通过了《关于富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金持续运作有关事项的议案》，本基金持续运作，运作方式不发生改变，并继续现有投资策略，推进平稳运作。上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

### 11.2 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：

1、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，督察长任晓伟已于2023年12月12日起恢复履职，总经理杨小舟自2023年12月12日起不再代行督察长职务。上述人事变动已按相关规定备案。

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。

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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未出现变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请安永华明会计师事务所提供审计服务，报告期内无需支付审计费用。截止本报告期末，该事务所向本基金提供审计服务6年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2023年09月06日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正，相关高级管理人员被出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人已及时整改并报告，整改措施主要包括完善内控制度、优化管控流程。
其他	无

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	58,070,272.52	100.00%	55,491.49	100.00%	-

注：（1）基金交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。（2）基金交

易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。(3)报告期内证券交易单元退租华西证券和海通证券。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	16,304.40	100.00%	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年第4季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
2	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-03
3	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
4	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-15
5	关于以通讯方式召开富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-28
6	关于以通讯方式召开富荣福鑫灵活配置混合型证券投资	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29

	基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告		
7	关于以通讯方式召开富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
8	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年年度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
9	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-07
10	富荣基金管理有限公司住所变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-12
11	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第1季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24
12	富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会 表决结果暨决议生效的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-28
13	富荣基金管理有限公司关于总经理代为履行督察长职务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
14	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
15	富荣基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-17
16	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-29

	购费率优惠活动的公告		
17	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第2季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-21
18	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年中期报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-31
19	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海大智慧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	2023-09-08
20	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	2023-09-23
21	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-13
22	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第3季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-25
23	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海中正达广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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-01

	率优惠活动的公告		
24	富荣基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-09
25	富荣基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-14
26	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增国金证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-20
27	富荣基金管理有限公司关于督察长恢复履行职务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-12
28	富荣基金管理有限公司关于系统升级维护的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-14
29	关于以通讯方式召开富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-18
30	关于以通讯方式召开富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-19
31	关于以通讯方式召开富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-20

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101 - 20231231	3,950,147.68	0.00	2,430,000.00	1,520,147.68	43.12%
	2	20230119 - 20230202	0.00	3,929,659.10	3,929,659.10	0.00	0.00%
个人	1	20231227 - 20231231	802,489.96	0.00	0.00	802,489.96	22.76%

### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并6个月内召开基金份额持有人大会；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

管理人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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会批准富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 13.1.2 《富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 13.1.3 《富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 13.1.5 报告期内富荣福鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 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  
二〇二四年三月三十日