

富荣沪深 300 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	富荣沪深300指数增强	
基金主代码	004788	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年01月24日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	863,248,546.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣沪深300指数增强 A	富荣沪深300指数增强 C
下属分级基金的交易代码	004788	004789
报告期末下属分级基金的份额总额	464,512,668.09份	398,735,878.50份

2.2 基金产品说明

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

	金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富荣基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	任晓伟	张姗
	联系电话	0755-84356633	400-61-95555
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-685-5600	400-61-95555
传真		0755-83230787	0755-83195201
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518038	518040
法定代表人		王亦伟	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	富荣沪深300指数增 强A	富荣沪深300指数 增强C
本期已实现收益	-87,367,713.63	-82,311,612.21
本期利润	6,631,519.96	8,366,524.35
加权平均基金份额本期利润	0.0138	0.0187
本期加权平均净值利润率	0.85%	1.16%
本期基金份额净值增长率	1.19%	1.13%
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	141,537,414.60	117,255,366.43
期末可供分配基金份额利润	0.3047	0.2941
期末基金资产净值	756,729,267.97	645,209,642.35
期末基金份额净值	1.6291	1.6181
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	126.14%	124.86%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富荣沪深300指数增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.62%	0.44%	-3.14%	0.46%	0.52%	-0.02%
过去三个月	-0.48%	0.72%	-2.03%	0.72%	1.55%	0.00%
过去六个月	1.19%	0.90%	0.88%	0.85%	0.31%	0.05%
过去一年	-7.98%	0.89%	-9.38%	0.83%	1.40%	0.06%
过去三年	-21.03%	1.08%	-32.19%	0.99%	11.16%	0.09%
自基金合同 生效起至今	126.14%	1.21%	10.27%	1.13%	115.87%	0.08%

富荣沪深300指数增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.64%	0.44%	-3.14%	0.46%	0.50%	-0.02%
过去三个月	-0.51%	0.72%	-2.03%	0.72%	1.52%	0.00%
过去六个月	1.13%	0.90%	0.88%	0.85%	0.25%	0.05%
过去一年	-8.08%	0.89%	-9.38%	0.83%	1.30%	0.06%
过去三年	-21.27%	1.08%	-32.19%	0.99%	10.92%	0.09%
自基金合同 生效起至今	124.86%	1.21%	10.27%	1.13%	114.59%	0.08%

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

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

富荣沪深300指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



富荣沪深300指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§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		
郎骋成	研究部总经理、基金经理	2020-07-16	-	17.5	硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任锦泰期货有限公司宏观和化工研究员、金东矿业股份有限公司主持上市办公室工作、弘业期货股份有限公司投资咨询负责人及研究所所长、摩根士丹利华鑫基金另类投资小组副组长/专户投资经理/专户理财部副总监。2020年6月加入富荣基金。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
郎骋成	公募基金	2	1,408,534,677.60	2020-07-16
	私募资产管理计划	1	48,361,332.54	2020-09-22

	其他组合	-	-	-
	合计	3	1,456,896,010.14	-

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

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

2024年上半年，需求不足的问题仍然是国内经济增长较大的困扰，受此影响，企业只能通过以价换量参与国内竞争或是积极出海争取更多市场的方式进行应对。然而，“去全球化”仍是海外主要经济体当前的战略重点，部分企业的出海进程并不顺利，影响了部分行业的盈利表现。A股市场上，随着新“国九条”的发布，市场参与者对上市公司的质量关注度大幅提升，经营确定性较差的小市值公司被市场“抛弃”，由此导致主要

宽基指数收益率出现了明显分层。报告期内，上证50上涨2.95%，沪深300上涨0.89%，上证指数下跌0.25%，创业板指下跌10.99%，科创50下跌16.42%，中证1000下跌16.84%。从申万一级行业指数看，防御板块表现突出，银行、煤炭和公用事业分别上涨17.02%、11.96%和11.76%，而小市值公司较多的行业跌幅较多，综合、计算机和商贸零售分别下跌33.34%、24.88%和24.59%，在申万31个一级行业中跌幅居前。

报告期内，本基金稳健运作，仓位基本稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣沪深300指数增强A基金份额净值为1.6291元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.19%，同期业绩比较基准收益率为0.88%；截至报告期末富荣沪深300指数增强C基金份额净值为1.6181元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.13%，同期业绩比较基准收益率为0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

3月初政府工作报告中提出财政政策要“适度加力”后，市场对于全年的财政支出抱有很大的期待。但时间来到6月末，我们整理公开数据后发现，2024年上半年累计新增专项债发行规模仅占全年新增专项债限额的38%，进度明显落后于2023年同期60%的水平，发行节奏远低于预期。这种情况的发生，客观上既有财政收入偏弱约束支出的原因，也有地方化债的影响。我们看到，在实体需求偏弱，居民信心不足的现状下，私人部门的消费和投机诉求不强，近几个月的社融数据已经反映出通过信贷投放货币的难度在加大，内生货币的派生效果有限。而通过财政手段让外生货币进入实体，既可以显著增加总需求，缩小当前面临的产业供需缺口，也能提升私人部门的净资产，改善收入的预期，改变当前私人部门“安全性优先”的配置偏好。因此，我们认为财政发力的意愿和节奏会对经济前景产生较为明显的影响，财政的支出强度和支出节奏是我们未来半年最重要的关注点。

2024年上半年，货币政策的发力不足受到了一部分人的关注，也有一些质疑文章被广泛流传。在我们看来，从十九大报告中明确提出“健全货币政策和宏观审慎政策双支柱调控框架”开始，宏观调控决策的多目标制就变得更加复杂，货币政策难免受到任何一个目标接近甚至突破“合意区间”而导致目标权重调整的掣肘。在我们的理解中，“货币政策和宏观审慎政策双支柱调控框架”下，货币政策的目标是币值稳定、经济增长和充分就业，而宏观审慎政策的唯一目标是金融稳定。进入2024年，商业银行净息差环比加速下行、信贷资金空转套利、长期国债交易拥挤和直接投资跨境收支逆差创新高等问题纷纷涌现，对金融稳定产生了较大的挑战。我们认为，目前为止货币政策在价格方面的相对克制，就是因为在宏观审慎的原则下降息对预防金融风险帮助较小（降息无法改善商业银行净息差、更低成本的贷款会鼓励资金空转和跨境人民币流出、利率调整过快

会加剧债券市场波动)。而货币政策调整迟缓的代价是国内实际利率过高,对经济增长产生的负面影响。站在当下,国内2季度GDP低于预期的现实可能会带来调控目标权重的变化,再配合美联储降息概率的提升,货币政策调整窗口或将再次打开,有助于提升资本市场的风险偏好。

PPI拐点的出现意味着企业利润大概率已经触底,后续如果私人部门的风险偏好能够改善,货币重新活化,宏观经济将再现活力。对于A股而言,“国九条”发布后小市值公司的回调已经挤出了大部分的溢价泡沫,在上证指数低于3000点的当下,我们判断股票价格隐含的中期回报已经足够具备吸引力,看好下一阶段A股的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

截止2024年6月30日，根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期末未有收益分配事项。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富荣沪深300指数增强型证券投资基金

报告截止日：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	84,229,549.62	46,344,707.97
结算备付金		21,665,745.11	33,389,209.74
存出保证金		184,556.14	181,048.91
交易性金融资产	6.4.7.2	1,303,050,701.47	1,575,686,513.74
其中：股票投资		1,226,151,608.05	1,496,675,684.92
基金投资		-	-
债券投资		76,899,093.42	79,010,828.82
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		568,645.51	1,853,322.57
应收股利		-	-
应收申购款		1,558,407.97	3,809,016.41
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,411,257,605.82	1,661,263,819.34
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		5,136,897.35	-
应付赎回款		2,258,465.37	3,370,258.84
应付管理人报酬		707,679.77	833,074.18
应付托管费		117,946.63	138,845.71

应付销售服务费		54,866.35	67,774.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	1,042,840.03	882,304.06
负债合计		9,318,695.50	5,292,257.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	863,248,546.59	1,031,737,452.69
未分配利润	6.4.7.7	538,690,363.73	624,234,109.18
净资产合计		1,401,938,910.32	1,655,971,561.87
负债和净资产总计		1,411,257,605.82	1,661,263,819.34

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额863,248,546.59份。A类基金份额净值人民币1.6291元，基金份额总额464,512,668.09份。C类基金份额净值人民币1.6181元，基金份额总额398,735,878.50份。

6.2 利润表

会计主体：富荣沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：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		20,819,529.14	-44,060,907.68
1.利息收入		172,653.32	318,774.87
其中：存款利息收入	6.4.7.8	172,653.32	318,774.87
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）		-164,209,735.37	-3,091,737.38
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-181,191,545.10	-31,536,445.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	721,095.13	986,391.78
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-	-
股利收益	6.4.7.12	16,260,714.60	27,458,315.87
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	184,677,370.15	-41,895,602.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	179,241.04	607,657.14
减：二、营业总支出		5,821,484.83	8,107,946.83
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	4,481,960.41	6,248,046.67
2.托管费	6.4.10.2.2	746,993.39	1,041,341.10
3.销售服务费	6.4.10.2.3	359,322.21	536,702.84
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.15	-	-
7.税金及附加		-	0.50
8.其他费用	6.4.7.16	233,208.82	281,855.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,998,044.31	-52,168,854.51

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,998,044.31	-52,168,854.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,998,044.31	-52,168,854.51

6.3 净资产变动表

会计主体：富荣沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：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	1,031,737,452.69	624,234,109.18	1,655,971,561.87
二、本期期初净资产	1,031,737,452.69	624,234,109.18	1,655,971,561.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-168,488,906.10	-85,543,745.45	-254,032,651.55
（一）、综合收益总额	-	14,998,044.31	14,998,044.31
（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）	-168,488,906.10	-100,541,789.76	-269,030,695.86
其中：1.基金申购款	146,938,460.38	88,018,237.23	234,956,697.61
2.基金赎回款	-315,427,366.48	-188,560,026.99	-503,987,393.47
（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	863,248,546.59	538,690,363.73	1,401,938,910.32
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	1,172,000,341.98	953,940,741.96	2,125,941,083.94
二、本期期初净资产	1,172,000,341.98	953,940,741.96	2,125,941,083.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-96,219,648.10	-130,768,417.40	-226,988,065.50
（一）、综合收益总额	-	-52,168,854.51	-52,168,854.51
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-96,219,648.10	-78,599,562.89	-174,819,210.99
其中：1.基金申购款	416,136,027.44	360,929,644.96	777,065,672.40
2.基金赎回款	-512,355,675.54	-439,529,207.85	-951,884,883.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,075,780,693.88	823,172,324.56	1,898,953,018.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

杨小舟

黄文飞

黄文飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富荣沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系由富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来。富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]726号文《关于准予富荣福泰灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富荣基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2018年2月11日正式生效，首次设立募集规模为201,121,576.58份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为富荣基金管理有限公司，登记机构为富荣基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

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

本基金主要投资于沪深300指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、地方政府债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于80%，投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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	84,229,549.62
等于：本金	84,222,227.77
加：应计利息	7,321.85
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	84,229,549.62

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	1,481,315,889.06	-	1,226,151,608.05	-255,164,281.01	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	75,976,685.01	917,093.42	76,899,093.42	5,314.99
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	75,976,685.01	917,093.42	76,899,093.42	5,314.99
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,557,292,574.07	917,093.42	1,303,050,701.47	-255,158,966.02	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	447.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	813,474.90
其中：交易所市场	813,474.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,398.38
其他应付	119,518.94
合计	1,042,840.03

6.4.7.6 实收基金**6.4.7.6.1 富荣沪深300指数增强A**

金额单位：人民币元

项目 (富荣沪深300指数增强A)	本期 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	521,431,041.70	521,431,041.70
本期申购	65,678,279.23	65,678,279.23
本期赎回(以“-”号填列)	-122,596,652.84	-122,596,652.84
本期末	464,512,668.09	464,512,668.09

6.4.7.6.2 富荣沪深300指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (富荣沪深300指数增强C)	本期 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	510,306,410.99	510,306,410.99
本期申购	81,260,181.15	81,260,181.15
本期赎回（以“-”号填列）	-192,830,713.64	-192,830,713.64
本期末	398,735,878.50	398,735,878.50

注:申购包含基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.7 未分配利润**6.4.7.7.1 富荣沪深300指数增强A**

单位：人民币元

项目 (富荣沪深300指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	252,708,511.57	65,355,266.26	318,063,777.83
本期期初	252,708,511.57	65,355,266.26	318,063,777.83
本期利润	-87,367,713.63	93,999,233.59	6,631,519.96
本期基金份额交易产生的变动数	-23,803,383.34	-8,675,314.57	-32,478,697.91
其中：基金申购款	25,521,636.81	14,158,670.75	39,680,307.56
基金赎回款	-49,325,020.15	-22,833,985.32	-72,159,005.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	141,537,414.60	150,679,185.28	292,216,599.88

6.4.7.7.2 富荣沪深300指数增强C

单位：人民币元

项目 (富荣沪深300指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----------------------	-------	-------	---------

上年度末	241,715,901.78	64,454,429.57	306,170,331.35
本期期初	241,715,901.78	64,454,429.57	306,170,331.35
本期利润	-82,311,612.21	90,678,136.56	8,366,524.35
本期基金份额交易产生的变动数	-42,148,923.14	-25,914,168.71	-68,063,091.85
其中：基金申购款	30,419,914.18	17,918,015.49	48,337,929.67
基金赎回款	-72,568,837.32	-43,832,184.20	-116,401,021.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,255,366.43	129,218,397.42	246,473,763.85

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	141,254.92
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	29,998.50
其他	1,399.90
合计	172,653.32

注：其他为交易保证金利息收入。

6.4.7.9 股票投资收益

6.4.7.9.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	1,083,912,587.87
减：卖出股票成本总额	1,263,005,412.31
减：交易费用	2,098,720.66
买卖股票差价收入	-181,191,545.10

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	792,105.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-71,010.02
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	721,095.13

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	80,678,773.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	79,172,775.01
减：应计利息总额	1,577,008.36
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-71,010.02

6.4.7.11 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具产生的投资收益/损失。

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	16,260,714.60
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	16,260,714.60

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	184,677,370.15
——股票投资	184,609,780.15
——债券投资	67,590.00
——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	184,677,370.15

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	178,732.98
转换费收入	508.06
合计	179,241.04

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

6.4.7.15 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,291.50
指数使用费	119,518.94
合计	233,208.82

6.4.7.17 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,481,960.41	6,248,046.67

其中：应支付销售机构的客户维护费	1,848,575.03	2,292,003.98
应支付基金管理人的净管理费	2,633,385.38	3,956,042.69

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

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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	746,993.39	1,041,341.10

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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		
	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	30,096.44	30,096.44
合计	0.00	30,096.44	30,096.44
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		

	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C	合计
富荣基金管理 有限公司	0.00	78,337.65	78,337.65
合计	0.00	78,337.65	78,337.65

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费。本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.10%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

本基金于本报告期内及上年度可比期间内均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

本基金于本报告期内及上年度可比期间内均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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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末未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间

称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行 股份有限 公司	84,229,549.62	141,254.92	87,714,043.72	238,506.76

注：本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 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的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金于本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603285	键邦股份	2024-06-28	5个交易日	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	科创板打新限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	5个交易日	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月	创业板打新限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	创业板打新限售	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	创业板打新限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	创业板打新限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗	2024-02-23	6个月	新股锁定	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-

	科技									
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	科创板打新限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	创业板打新限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	创业板打新限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	创业板打新限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	创业板打新限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	创业板打新限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	科创板打新限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月	科创板打新限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	创业板打新限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	创业板打新限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股锁定	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股锁定	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 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出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	76,899,093.42	79,010,828.82
合计	76,899,093.42	79,010,828.82

注:1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据和部分短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
--------------------	------	------	------	-----	----

资产					
货币资金	84,229,549.62	-	-	-	84,229,549.62
结算备付金	21,665,745.11	-	-	-	21,665,745.11
存出保证金	184,556.14	-	-	-	184,556.14
交易性金融资产	76,899,093.42	-	-	1,226,151,608.05	1,303,050,701.47
应收清算款	-	-	-	568,645.51	568,645.51
应收申购款	-	-	-	1,558,407.97	1,558,407.97
资产总计	182,978,944.29	-	-	1,228,278,661.53	1,411,257,605.82
负债					
应付清算款	-	-	-	5,136,897.35	5,136,897.35
应付赎回款	-	-	-	2,258,465.37	2,258,465.37
应付管理人报酬	-	-	-	707,679.77	707,679.77
应付托管费	-	-	-	117,946.63	117,946.63
应付销售服务费	-	-	-	54,866.35	54,866.35
其他负债	-	-	-	1,042,840.03	1,042,840.03
负债总计	-	-	-	9,318,695.50	9,318,695.50
利率敏感度缺口	182,978,944.29	-	-	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	46,344,707.97	-	-	-	46,344,707.97
结算备付金	33,389,209.74	-	-	-	33,389,209.74
存出保证金	181,048.91	-	-	-	181,048.91
交易性金融资产	79,010,828.82	-	-	1,496,675,684.92	1,575,686,513.74
应收清算款	-	-	-	1,853,322.57	1,853,322.57
应收申购款	-	-	-	3,809,016.41	3,809,016.41
资产总计	158,925,795.44	-	-	1,502,338,023.90	1,661,263,819.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,370,258.84	3,370,258.84
应付管理人报酬	-	-	-	833,074.18	833,074.18
应付托管费	-	-	-	138,845.71	138,845.71
应付销售服务费	-	-	-	67,774.68	67,774.68
其他负债	-	-	-	882,304.06	882,304.06
负债总计	-	-	-	5,292,257.47	5,292,257.47

利率敏感度缺口	158,925,795.44	-	-	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市值占资产净值的5.49%（2023年12月31日：4.77%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	1,226,151,608.05	87.46	1,496,675,684.92	90.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	76,899,093.42	5.49	79,010,828.82	4.77
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—	-	-	-	-

权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	1,303,050,701.47	92.95	1,575,686,513.74	95.15

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%	71,610,176.02	83,194,878.57
	基金业绩比较基准下降5%	-71,610,176.02	-83,194,878.57

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

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	1,225,909,508.60	1,493,191,394.11
第二层次	76,944,704.53	79,082,869.02
第三层次	196,488.34	3,412,250.61
合计	1,303,050,701.47	1,575,686,513.74

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	1,226,151,608.05	86.88
	其中：股票	1,226,151,608.05	86.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	76,899,093.42	5.45

	其中：债券	76,899,093.42	5.45
	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	105,895,294.73	7.50
8	其他各项资产	2,311,609.62	0.16
9	合计	1,411,257,605.82	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,967,154.00	1.00
B	采矿业	71,765,580.00	5.12
C	制造业	625,417,832.00	44.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,096,833.00	4.22
E	建筑业	48,242,924.00	3.44
F	批发和零售业	19,542,087.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	50,657,030.00	3.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,492,405.00	1.53
J	金融业	283,479,487.60	20.22
K	房地产业	14,048,178.00	1.00
L	租赁和商务服务业	18,199,998.00	1.30
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	1,225,909,508.60	87.44

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	225,731.18	0.02
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	16,368.27	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	242,099.45	0.02

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	46,500	68,233,635.00	4.87
2	300750	宁德时代	367,200	66,107,016.00	4.72
3	601318	中国平安	1,500,000	62,040,000.00	4.43
4	600309	万华化学	613,400	49,599,524.00	3.54
5	002142	宁波银行	2,166,200	47,786,372.00	3.41
6	000001	平安银行	4,437,800	45,043,670.00	3.21
7	000858	五粮液	335,200	42,919,008.00	3.06
8	600031	三一重工	2,280,800	37,633,200.00	2.68
9	601899	紫金矿业	2,084,500	36,624,665.00	2.61
10	601985	中国核电	3,171,000	33,802,860.00	2.41
11	600887	伊利股份	1,249,800	32,294,832.00	2.30
12	601398	工商银行	5,393,500	30,742,950.00	2.19
13	600741	华域汽车	1,776,200	29,094,156.00	2.08
14	002415	海康威视	938,900	29,021,399.00	2.07
15	601390	中国中铁	4,421,700	28,829,484.00	2.06
16	601111	中国国航	3,879,200	28,628,496.00	2.04
17	601377	兴业证券	5,466,310	27,659,528.60	1.97
18	000776	广发证券	2,249,000	27,370,330.00	1.95
19	600795	国电电力	4,222,700	25,293,973.00	1.80

20	688981	中芯国际	536,500	24,732,650.00	1.76
21	000333	美的集团	372,000	23,994,000.00	1.71
22	300760	迈瑞医疗	81,300	23,650,983.00	1.69
23	600030	中信证券	1,202,700	21,925,221.00	1.56
24	601728	中国电信	3,494,700	21,492,405.00	1.53
25	000983	山西焦煤	2,046,500	21,099,415.00	1.51
26	600196	复星医药	947,000	20,966,580.00	1.50
27	601166	兴业银行	1,186,800	20,911,416.00	1.49
28	000963	华东医药	702,700	19,542,087.00	1.39
29	601117	中国化学	2,356,000	19,413,440.00	1.38
30	002027	分众传媒	3,003,300	18,199,998.00	1.30
31	002049	紫光国微	301,100	15,837,860.00	1.13
32	600150	中国船舶	385,500	15,693,705.00	1.12
33	600809	山西汾酒	72,300	15,246,624.00	1.09
34	002475	立讯精密	382,900	15,051,799.00	1.07
35	600372	中航机载	1,249,400	14,955,318.00	1.07
36	002352	顺丰控股	416,200	14,854,178.00	1.06
37	002459	晶澳科技	1,263,840	14,155,008.00	1.01
38	001979	招商蛇口	1,598,200	14,048,178.00	1.00
39	600938	中国海油	425,500	14,041,500.00	1.00
40	300498	温氏股份	704,700	13,967,154.00	1.00
41	600346	恒力石化	977,500	13,636,125.00	0.97
42	601012	隆基绿能	960,500	13,466,210.00	0.96
43	600019	宝钢股份	1,498,700	9,966,355.00	0.71
44	000625	长安汽车	689,000	9,253,270.00	0.66
45	002271	东方雨虹	660,500	8,150,570.00	0.58
46	600585	海螺水泥	307,700	7,258,643.00	0.52
47	600026	中远海能	459,600	7,174,356.00	0.51
48	000725	京东方 A	1,753,200	7,170,588.00	0.51
49	600276	恒瑞医药	181,500	6,980,490.00	0.50
50	603659	璞泰来	414,000	5,849,820.00	0.42

51	002466	天齐锂业	150,400	4,498,464.00	0.32
----	--------	------	---------	--------------	------

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
2	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
3	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
4	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
5	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
6	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
7	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
8	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
9	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
10	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
11	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
12	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
13	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
14	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
15	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
16	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
17	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
18	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
19	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
20	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
21	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
22	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
23	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
24	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00

25	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
26	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
27	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	41,902,831.58	2.53
2	600741	华域汽车	33,300,354.00	2.01
3	601390	中国中铁	30,309,171.00	1.83
4	601398	工商银行	29,262,851.00	1.77
5	601985	中国核电	28,212,879.00	1.70
6	000983	山西焦煤	27,671,677.00	1.67
7	300498	温氏股份	25,367,141.00	1.53
8	600030	中信证券	23,819,479.00	1.44
9	600674	川投能源	23,808,764.00	1.44
10	000963	华东医药	23,161,076.66	1.40
11	601728	中国电信	22,825,838.00	1.38
12	600795	国电电力	22,399,795.00	1.35
13	600150	中国船舶	18,317,337.00	1.11
14	002475	立讯精密	18,101,348.00	1.09
15	000725	京东方 A	18,011,864.00	1.09
16	000625	长安汽车	16,903,790.00	1.02
17	600809	山西汾酒	16,710,095.00	1.01
18	601658	邮储银行	16,425,735.00	0.99
19	600183	生益科技	15,747,301.80	0.95
20	600276	恒瑞医药	15,679,547.00	0.95

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	600660	福耀玻璃	62,328,208.36	3.76
2	601658	邮储银行	48,009,156.00	2.90
3	300014	亿纬锂能	38,133,668.00	2.30
4	603259	药明康德	38,092,658.56	2.30
5	002371	北方华创	35,352,978.00	2.13
6	600011	华能国际	34,061,495.00	2.06
7	600519	贵州茅台	33,783,318.00	2.04
8	002311	海大集团	33,420,679.00	2.02
9	000708	中信特钢	31,297,097.36	1.89
10	600233	圆通速递	31,226,283.52	1.89
11	603993	洛阳钼业	30,396,021.00	1.84
12	002475	立讯精密	30,005,184.00	1.81
13	300122	智飞生物	29,765,538.50	1.80
14	600690	海尔智家	27,246,838.00	1.65
15	601601	中国太保	26,015,773.00	1.57
16	600745	闻泰科技	25,611,858.20	1.55
17	600674	川投能源	24,429,605.00	1.48
18	600585	海螺水泥	19,599,038.00	1.18
19	000333	美的集团	19,024,386.00	1.15
20	688599	天合光能	17,345,909.69	1.05

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	807,871,555.29
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	1,083,912,587.87
--------------	------------------

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	76,899,093.42	5.49
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	76,899,093.42	5.49

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	019727	23国债24	383,000	38,996,692.74	2.78
2	019733	24国债02	375,000	37,902,400.68	2.70

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，平安银行在报告编制日前一年内因未依法履行其他职责、违反反洗钱管理规定、违法经营受到国家金融监督管理总局及中国人民银行处分。宁波银行在报告编制日前一年内因未依法履行其他职责受到国家金融监督管理总局处分。

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	184,556.14
2	应收清算款	568,645.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,558,407.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,311,609.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股锁定
2	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股锁定
3	688709	成都华微	19,635.55	0.00	科创板打新限售
4	301536	星辰科技	15,521.87	0.00	创业板打新限售
5	301538	骏鼎达	13,686.00	0.00	创业板打新限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
富荣沪深300	63,980	7,260.28	3,863,018.14	0.8316%	460,649,649.95	99.1684%

指数增强A						
富荣沪深300指数增强C	85,166	4,681.87	15,090,159.25	3.7845%	383,645,719.25	96.2155%
合计	145,486	5,933.55	18,953,177.39	2.1956%	844,295,369.20	97.8044%

注：①分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

②户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	富荣沪深300指数增强A	143,192.10	0.03%
	富荣沪深300指数增强C	18,631.65	0.00%
	合计	161,823.75	0.02%

注：①分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富荣沪深300指数增强A	0~10
	富荣沪深300指数增强C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	富荣沪深300指数增强A	0~10
	富荣沪深300指数增强C	0

	合计	0~10
--	----	------

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣沪深300指数增强A	富荣沪深300指数增强C
基金合同生效日(2019年01月24日)基金份额总额	70,918.32	19,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	521,431,041.70	510,306,410.99
本报告期基金总申购份额	65,678,279.23	81,260,181.15
减：本报告期基金总赎回份额	122,596,652.84	192,830,713.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	464,512,668.09	398,735,878.50

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未出现变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	463,382,021.09	24.51%	354,899.86	24.72%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	745,361,398.20	39.43%	558,491.95	38.90%	-
国盛证券	2	212,401,845.13	11.24%	162,679.41	11.33%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	256,887,873.84	13.59%	196,751.04	13.71%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	147,714,083.85	7.81%	113,134.26	7.88%	-
东方财富证券	3	64,760,343.93	3.43%	49,599.68	3.46%	-

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新开交易席位为麦高证券、东吴证券，退租国投证券。（4）本基金管理人已于2024年7月1日根据《公开募集

《证券投资基金证券交易费用管理规定》及证券业协会测算结果完成佣金费率调整，相关证券公司选择标准和程序将按新规执行。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	37,602,000.00	46.90%	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	39,777,415.01	49.61%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	2,801,764.99	3.49%	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-22

3	富荣基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-30
7	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2024年第1季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-22
8	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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-18
9	富荣基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金更新产品资料概要的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27
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	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

	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		
--	--------------------------------	--	--

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 12.1.2 《富荣沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 12.1.3 《富荣沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 12.1.5 报告期内富荣沪深300指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

富荣基金管理有限公司
二〇二四年八月三十一日