

富荣福康混合型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03月21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2024年01月01日起至2024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	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、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	7
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	11
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	80
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	81
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	81
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	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	81

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
8.12 投资组合报告附注	81
§9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
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	83
§10 开放式基金份额变动	83
§11 重大事件揭示	84
11.1 基金份额持有人大会决议	84
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	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
11.4 基金投资策略的改变	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
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	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
11.8 其他重大事件	86
§12 影响投资者决策的其他重要信息	90
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	90
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	91
§13 备查文件目录	91
13.1 备查文件目录	91
13.2 存放地点	91
13.3 查阅方式	91

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣福康混合型证券投资基金	
基金简称	富荣福康混合	
基金主代码	005104	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年02月11日	
基金管理人	富荣基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,843,366.30份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣福康混合A	富荣福康混合C
下属分级基金的交易代码	005104	005105
报告期末下属分级基金的份额总额	4,750,201.03份	4,093,165.27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*30%+沪深300指数收益率*70%
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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨小舟（代行）	王茵
	联系电话	0755-84356633	010-63639180
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-685-5600	95595
传真		0755-83230787	010-63639132
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		518038	100033
法定代表人		王亦伟	吴利军

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	http://www.furamc.com.cn/
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	2024年		2023年		2022年	
	富荣福康混合A	富荣福康混合C	富荣福康混合A	富荣福康混合C	富荣福康混合A	富荣福康混合C
本期已实现收益	-191,207.98	-1,119,568.85	-431,177.27	-2,440,308.26	-130,227.92	-167,687.31
本期利润	-361,492.02	-1,352,635.91	-190,589.88	-2,003,430.43	-491,057.77	-972,077.79
加权平均基金份额本期利润	-0.1446	-0.1541	-0.0763	-0.1786	-0.1563	-0.1812
本期加权平均净值利润率	-17.27%	-18.71%	-7.20%	-17.29%	-14.75%	-17.37%
本期基金份额净值增长率	-12.05%	-12.06%	-11.06%	-11.06%	-13.83%	-13.84%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	-820,949.67	-756,638.62	-133,536.23	-730,397.27	145,473.18	282,047.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1728	-0.1849	-0.0595	-0.0731	0.0574	0.0422
期末基金资产净值	3,929,251.36	3,336,526.65	2,110,973.38	9,265,917.41	2,679,736.22	6,962,686.79
期末基金份额净值	0.8272	0.8151	0.9405	0.9269	1.0574	1.0422
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	-17.28%	-18.49%	-5.95%	-7.31%	5.74%	4.22%

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

富荣福康混合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④	①-③	②-④
过去三个月	-4.70%	2.98%	-0.36%	1.21%	-4.34%	1.77%

过去六个月	5.36%	2.72%	11.19%	1.15%	-5.83%	1.57%
过去一年	-12.05%	2.36%	13.43%	0.93%	-25.48%	1.43%
过去三年	-32.59%	1.72%	-9.28%	0.82%	-23.31%	0.90%
过去五年	-5.88%	1.60%	7.07%	0.86%	-12.95%	0.74%
自基金合同生效起至今	-17.28%	1.47%	17.36%	0.87%	-34.64%	0.60%

富荣福康混合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	-4.71%	2.98%	-0.36%	1.21%	-4.35%	1.77%
过去六个月	5.35%	2.72%	11.19%	1.15%	-5.84%	1.57%
过去一年	-12.06%	2.36%	13.43%	0.93%	-25.49%	1.43%
过去三年	-32.61%	1.72%	-9.28%	0.82%	-23.33%	0.90%
过去五年	-7.15%	1.60%	7.07%	0.86%	-14.22%	0.74%
自基金合同生效起至今	-18.49%	1.47%	17.36%	0.87%	-35.85%	0.60%

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

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

富荣福康混合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11日-2024年12月31日)



富荣福康混合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11日-2024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

截至2024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，办公地位于深圳市福田区八卦岭八卦四路安吉尔大厦24楼，注册资本金人民币2亿元。富荣基金定位于“综合金融服务商”，围绕客户需求，贯彻投资人利益优先原则，秉持“规范创造价值，创新推动成长”的经营理念，努力打造企业核心竞争力，整合产业上下游资源，为各类投资者提供充分满足个性需求的产品，并以稳定、持续、优秀的投资业绩和全面、及时、优质的服务回报投资者的信任，与投资者共同分享中国经济发展的成果，致力成为受人尊重、有价值的综合金融服务企业领先者。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任 日期		
李天翔	基金经理	2023-03-08	-	5.5	硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任中融基金管理有限公司研究部周期行业研究员，2020年加入富荣基金管理有限公司，历任富荣基金管理有限公司研究部周期行业和医药行业研究员，现任富荣基金管理有限公司基金经理。

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。

3、姜帆自2025年2月13日起担任本基金基金经理。

4、李天翔自2025年2月19日起离任本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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

2024年，本基金整体遵循“中长期增长能力+估值性价比”的核心策略，动态调整行业配置以应对市场变化。由于受内外流动性和市场风格转换影响，产品在前三季度和第四季度的策略略有不同。前三季度产品重点超配具备中长期增长能力的行业，如医药、高端制造等。医药行业因估值处于历史低位区间以及兼顾长期增长的确定性而受到了我们的重点关注，同时政策的转向支持（创新药审批加速、老龄化需求刚性）也带来了一定的催化，但核心的思路还是以低估值做防守。2024年10月以后，随着市场流动性改善

及风险偏好提升，策略转向对短期业绩增速容忍度更高的科技成长领域。在降低医药等防守性行业持仓的同时，增配AI、半导体、人形机器人等新技术产业链。

尽管策略灵活调整，但全年依然跑输业绩比较基准，主要原因我们归结为：第一，宏观经济波动超预期：上半年国内经济复苏力度不足，消费与制造业需求疲软，医药行业受集采政策深化影响，虽然有政策端的其他利好支持，但宏观压力和医保压力下，市场整体信心不足。第二，风格切换剧烈：下半年流动性宽松推动小盘股及主题投资活跃，我们虽然有动态调整去布局一定的新产业、新技术，但还是未能及时捕捉细分领域弹性标的（如通信设备、电子元器件等），错失部分超额收益。第三，轮动过快与估值压力：AI、半导体等板块在政策催化下短期涨幅过大，但盈利兑现能力不足，导致组合回撤加剧。

最后，我们观察到，在第四季度，被动型ETF资金大规模涌入权重行业（如沪深300成分股），削弱了主动选股的阿尔法收益，也加剧了组合波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣福康混合A基金份额净值为0.8272元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.05%，同期业绩比较基准收益率为13.43%；截至报告期末富荣福康混合C基金份额净值为0.8151元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.06%，同期业绩比较基准收益率为13.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2025年，我国经济的结构转型依然在路，新老动能切换过程中，房地产的拖累需要进一步减轻和消除，我们认为其核心是价格端的止跌回稳。价格端实现修复，居民的资产负债表才能实现修复，消费才有刺激的效果。因此后续诸如收储在内的地产政策将是我们对“老动能”观察的核心风向标之一。

除此之外，在投资层面，我们认为地方政府的杠杆率也受地产问题影响较大，而中央层面的杠杆在相关指引下也较难超预期；在出口层面，美联储持续降息的预期回落叠加特朗普提高关税的政策悬而未定，所以整体的不确定性依然在增加。

但我们对积极的货币和财政政策保持乐观，对产业政策保持乐观，因此，在“新动能”方面，产业升级和新质生产力突破性发展将会持续贡献新增量。我们中长期的研究和投资重心将依然放在包括医药、科技在内的具有全球竞争优势的高新技术产业当中。

2024年的业绩压力凸显了市场环境下策略灵活性与风控机制的重要性。2025年，本基金将结合政策导向与产业趋势，在坚守价值主线的基础上，通过更精细的行业轮动与工具创新，力争实现收益与风险的再平衡。

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历,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。

截止2024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。

本报告期内本基金管理人承担本基金部分基金费用（如有），如审计费、信息披露费等。

§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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在富荣福康混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《富荣福康混合型证券投资基金2024年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§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（2025）审字第70036562_H05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	富荣福康混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富荣福康混合型证券投资基金的财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024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，后附的富荣福康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，公允反映了富荣福康混合型证券投资基金2024年12月31日的财务状况以及2024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，我们独立于富荣福康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	富荣福康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	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康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。 治理层负责监督富荣福康混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 （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，就可能导致对富荣福康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康混合型证券投资基金不能持续经营。 （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。
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	赵雅、于玉涵

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	2025-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富荣福康混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	24,698.47	669,542.65
结算备付金		251,611.21	197,791.79
存出保证金		16,764.05	19,659.72
交易性金融资产	7.4.7.2	7,043,798.30	10,632,407.79
其中：股票投资		6,636,971.51	10,632,407.79
基金投资		-	-
债券投资		406,826.79	-
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		272,126.99	124,336.90
应收股利		-	-
应收申购款		21,641.65	671.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		7,630,640.67	11,644,410.70

负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		269,281.38	86,861.26
应付赎回款		3,353.32	23,597.66
应付管理人报酬		7,654.77	13,252.31
应付托管费		956.82	1,656.55
应付销售服务费		29.38	92.27
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	83,586.99	142,059.86
负债合计		364,862.66	267,519.91
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	8,843,366.30	12,240,824.29
未分配利润	7.4.7.8	-1,577,588.29	-863,933.50
净资产合计		7,265,778.01	11,376,890.79
负债和净资产总计		7,630,640.67	11,644,410.70

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额8,843,366.30份，其中，下属A类基金份额净值0.8272元，基金份额总额4,750,201.03份；下属C类基金份额净值0.8151元，基金份额总额4,093,165.27份。

7.2 利润表

会计主体：富荣福康混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
一、营业总收入		-1,541,143.89	-1,899,042.00
1.利息收入		6,828.01	13,291.74
其中：存款利息收入	7.4.7.9	6,828.01	13,291.74
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,165,445.94	-2,604,098.93
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,245,688.06	-2,813,148.50
基金投资收益	7.4.7.11	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	3,566.35	186.14
资产支持证券投资	7.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	76,675.77	208,863.43
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-403,351.10	677,465.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	20,825.14	14,299.97
减：二、营业总支出		172,984.04	294,978.31
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	112,203.39	198,740.97
2.托管费	7.4.10.2.2	14,025.48	21,334.94

3.销售服务费	7.4.10.2.3	728.42	1,156.90
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	7.4.7.19	46,026.75	73,745.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,714,127.93	-2,194,020.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,714,127.93	-2,194,020.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,714,127.93	-2,194,020.31

7.3 净资产变动表

会计主体：富荣福康混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2024年01月01日至2024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	12,240,824.29	-863,933.50	11,376,890.79
二、本期期初净资产	12,240,824.29	-863,933.50	11,376,890.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,397,457.99	-713,654.79	-4,111,112.78
（一）、综合收益	-	-1,714,127.93	-1,714,127.93

总额			
（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）	-3,397,457.99	1,000,473.14	-2,396,984.85
其中：1.基金申购款	14,896,798.79	-1,713,087.85	13,183,710.94
2.基金赎回款	-18,294,256.78	2,713,560.99	-15,580,695.79
（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	8,843,366.30	-1,577,588.29	7,265,778.01
项 目	上年度可比期间 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	9,214,902.79	427,520.22	9,642,423.01
二、本期期初净资产	9,214,902.79	427,520.22	9,642,423.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,025,921.50	-1,291,453.72	1,734,467.78
（一）、综合收益总额	-	-2,194,020.31	-2,194,020.31
（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）	3,025,921.50	902,566.59	3,928,488.09

其中：1.基金申购款	11,286,086.61	1,329,229.46	12,615,316.07
2.基金赎回款	-8,260,165.11	-426,662.87	-8,686,827.98
（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	12,240,824.29	-863,933.50	11,376,890.79

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

富荣福康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]867号文《关于准予富荣福康混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，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203,621,721.42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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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、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50%-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%。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：中证全债指数收益率×30%+沪深300指数收益率×70%。

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、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2024年12月31日的财务状况以及2024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务工具投资的，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）本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本基金；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) 增值税及附加

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征增值税试点的通知》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。

（2）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[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。

（3）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，（如有）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，（如有）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。

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	24,698.47	669,542.65
等于：本金	24,689.60	669,341.74
加：应计利息	8.87	200.91
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	24,698.47	669,542.65
----	-----------	------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,912,637.97	-	6,636,971.51	-275,666.46
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	401,981.00	5,946.79	406,826.79	-1,101.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	401,981.00	5,946.79	406,826.79	-1,101.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,314,618.97	5,946.79	7,043,798.30	-276,767.46
项目		上年度末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		10,505,824.15	-	10,632,407.79	126,583.64
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		10,505,824.15	-	10,632,407.79	126,583.64

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

本基金于本报告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

本基金于本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.01	0.03
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	83,586.98	132,559.83
其中：交易所市场	83,586.98	132,559.83
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	-	9,500.00
合计	83,586.99	142,059.86

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 富荣福康混合A

金额单位：人民币元

项目 (富荣福康混合A)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,244,509.61	2,244,509.61

本期申购	3,038,155.39	3,038,155.39
本期赎回（以“-”号填列）	-532,463.97	-532,463.97
本期末	4,750,201.03	4,750,201.03

7.4.7.7.2 富荣福康混合C

金额单位：人民币元

项目 (富荣福康混合C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,996,314.68	9,996,314.68
本期申购	11,858,643.40	11,858,643.40
本期赎回（以“-”号填列）	-17,761,792.81	-17,761,792.81
本期末	4,093,165.27	4,093,165.27

注：申购含红利再投及转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 富荣福康混合A

单位：人民币元

项目 (富荣福康混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	236,672.64	-370,208.87	-133,536.23
本期期初	236,672.64	-370,208.87	-133,536.23
本期利润	-191,207.98	-170,284.04	-361,492.02
本期基金份额交易产生的变动数	79,648.67	-405,570.09	-325,921.42
其中：基金申购款	86,743.76	-503,689.43	-416,945.67
基金赎回款	-7,095.09	98,119.34	91,024.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,113.33	-946,063.00	-820,949.67

7.4.7.8.2 富荣福康混合C

单位：人民币元

项目 (富荣福康混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	807,961.16	-1,538,358.43	-730,397.27
本期期初	807,961.16	-1,538,358.43	-730,397.27
本期利润	-1,119,568.85	-233,067.06	-1,352,635.91
本期基金份额交易产生的变动数	322,926.63	1,003,467.93	1,326,394.56
其中：基金申购款	89,243.30	-1,385,385.48	-1,296,142.18
基金赎回款	233,683.33	2,388,853.41	2,622,536.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,318.94	-767,957.56	-756,638.62

7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	3,756.67	11,014.55
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	2,668.99	2,022.57
其他	402.35	254.62
合计	6,828.01	13,291.74

注：其他为交易保证金利息收入与应收申购款利息收入。

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 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	263,233,002.81	212,065,932.16

减：卖出股票成本总额	263,992,726.93	214,287,337.13
减：交易费用	485,963.94	591,743.53
买卖股票差价收入	-1,245,688.06	-2,813,148.50

7.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 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 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	5,610.36	1,862.14
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-2,044.01	-1,676.00
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	3,566.35	186.14

7.4.7.12.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	610,042.41	406,683.07
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑	602,812.01	401,764.00

付) 成本总额		
减: 应计利息总额	9,274.41	6,595.07
减: 交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-2,044.01	-1,676.00

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	76,675.77	208,863.43
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	76,675.77	208,863.43

7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	-403,351.10	677,465.22
——股票投资	-402,250.10	676,141.22
——债券投资	-1,101.00	1,324.00
——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	-403,351.10	677,465.22

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	20,351.87	14,227.93
基金转换费收入	473.27	72.04
合计	20,825.14	14,299.97

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。

7.4.7.18 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。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	-	5,000.00
信息披露费	-	-

证券出借违约金	-	-
汇划手续费	1,526.75	1,245.50
账户维护费	4,500.00	22,500.00
律师费	30,000.00	35,000.00
开户费	-	-
公证费	10,000.00	10,000.00
合计	46,026.75	73,745.50

注:本报告期内本基金管理人承担本基金部分基金费用（如有），如审计费、信息披露费等。

7.4.7.20 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 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。

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
中国光大银行股份有限公司	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内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 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	112,203.39	198,740.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,723.91	32,327.08
应支付基金管理人的净管理费	89,479.48	166,413.89

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

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	14,025.48	21,334.94

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0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%/ \text{当年天数}$$

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 2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福康混合A	富荣福康混合C	合计
富荣基金 管理有限 公司	0.00	453.07	453.07
光大银行 股份有限 公司	0.00	0.83	0.83
合计	0.00	453.90	453.90
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣福康混合A	富荣福康混合C	合计
富荣基金 管理有限 公司	0.00	874.06	874.06
合计	0.00	874.06	874.06

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0.01%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.01\% / \text{当年天数}$$

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

富荣福康混合A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	2,777,587.24	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,777,587.24	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	58.47%	-

富荣福康混合C

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
报告期初持有的基金份额	5,256,200.83	3,978,544.77
报告期间申购/买入总份额	-	3,477,656.06
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	2,790,000.00	2,200,000.00
报告期末持有的基金份额	2,466,200.83	5,256,200.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	60.25%	52.58%

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、申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额；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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
中国光大银行股份有限公司	24,698.47	3,756.67	669,542.65	11,014.55

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国光大银行保管，并按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期内及上年度可比期间内均无需说明的其他关联交易事项。

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无利润分配。

7.4.12 期末（2024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

本基金本报告期末未持有因认购新发/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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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2024年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年12月31日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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。本基金投资于基金合同和相关法律法规及监管机构允许范围内的投资品种。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、固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2024年12月31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和资产支持证券。（2023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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	202,526.79	-
合计	202,526.79	-

注：1.未评级债券为国债。
2.债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	204,300.00	-
合计	204,300.00	-

注:1.未评级债券为国债。

2.债券信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

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。

本基金主要投资于上市交易的证券，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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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 2024年1 2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	24,698.47	-	-	-	24,698.47
结算备付金	251,611.21	-	-	-	251,611.21
存出保证金	16,764.05	-	-	-	16,764.05
交易性金融资产	406,826.79	-	-	6,636,971.51	7,043,798.30

应收清算款	-	-	-	272,126.99	272,126.99
应收申购款	-	-	-	21,641.65	21,641.65
资产总计	699,900.52	-	-	6,930,740.15	7,630,640.67
负债					
应付清算款	-	-	-	269,281.38	269,281.38
应付赎回款	-	-	-	3,353.32	3,353.32
应付管理人报酬	-	-	-	7,654.77	7,654.77
应付托管费	-	-	-	956.82	956.82
应付销售服务费	-	-	-	29.38	29.38
其他负债	-	-	-	83,586.99	83,586.99
负债总计	-	-	-	364,862.66	364,862.66
利率敏感度缺口	699,900.52	-	-	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	669,542.65	-	-	-	669,542.65
结算备付金	197,791.79	-	-	-	197,791.79
存出保	19,659.72	-	-	-	19,659.72

证金					
交易性金融资产	-	-	-	10,632,407.79	10,632,407.79
应收清算款	-	-	-	124,336.90	124,336.90
应收申购款	-	-	-	671.85	671.85
资产总计	886,994.16	-	-	10,757,416.54	11,644,410.70
负债					
应付清算款	-	-	-	86,861.26	86,861.26
应付赎回款	-	-	-	23,597.66	23,597.66
应付管理人报酬	-	-	-	13,252.31	13,252.31
应付托管费	-	-	-	1,656.55	1,656.55
应付销售服务费	-	-	-	92.27	92.27
其他负债	-	-	-	142,059.86	142,059.86
负债总计	-	-	-	267,519.91	267,519.91
利率敏感度缺口	886,994.16	-	-	不适用	不适用

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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2024年12月31日，本基金持有的交易性债券投资和交易性资产支持证券投资市值占基金净资产的比例为5.60%（2023年12月31日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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 2024年12月31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	6,636,971.51	91.35	10,632,407.79	93.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	406,826.79	5.60	-	-
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	7,043,798.30	96.94	10,632,407.79	93.46

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	728,823.71	466,547.21
	基金业绩比较基准下降5%	-728,823.71	-466,547.21

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

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	6,636,971.51	10,632,407.79
第二层次	406,826.79	-
第三层次	-	-
合计	7,043,798.30	10,632,407.79

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

无。

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7,265,778.01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2025年3月27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	6,636,971.51	86.98
	其中：股票	6,636,971.51	86.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	406,826.79	5.33
	其中：债券	406,826.79	5.33
	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	276,309.68	3.62
8	其他各项资产	310,532.69	4.07
9	合计	7,630,640.67	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	-	-
C	制造业	4,073,682.21	56.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	276,948.00	3.81
F	批发和零售业	1,402,712.00	19.31
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	563,217.00	7.75
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	320,412.30	4.41
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	6,636,971.51	91.35

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	688358	祥生医疗	20,344	496,800.48	6.84
2	688981	中芯国际	4,568	432,224.16	5.95
3	301015	百洋医药	14,600	353,466.00	4.86
4	300430	诚益通	22,700	347,310.00	4.78
5	603214	爱婴室	14,600	329,376.00	4.53
6	688621	阳光诺和	8,499	320,412.30	4.41
7	688410	山外山	27,650	308,574.00	4.25
8	688613	奥精医疗	16,673	300,780.92	4.14
9	600419	天润乳业	31,900	296,989.00	4.09
10	000997	新大陆	14,400	287,280.00	3.95
11	600865	百大集团	24,400	287,188.00	3.95
12	002780	三夫户外	22,500	284,625.00	3.92

13	000032	深桑达 A	15,700	276,948.00	3.81
14	688068	热景生物	4,464	276,053.76	3.80
15	301236	软通动力	4,700	275,937.00	3.80
16	600521	华海药业	15,000	268,050.00	3.69
17	002765	蓝黛科技	30,200	259,720.00	3.57
18	688503	聚和材料	5,395	238,944.55	3.29
19	688122	西部超导	5,137	219,966.34	3.03
20	301033	迈普医学	5,100	214,455.00	2.95
21	002045	国光电器	9,600	208,224.00	2.87
22	300042	朗科科技	8,900	205,590.00	2.83
23	002416	爱施德	9,100	148,057.00	2.04

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	301236	软通动力	4,293,948.00	37.74
2	603259	药明康德	4,077,834.00	35.84
3	688621	阳光诺和	2,898,119.38	25.47
4	300719	安达维尔	2,845,160.50	25.01
5	688166	博瑞医药	2,792,116.63	24.54
6	688443	智翔金泰	2,768,038.29	24.33
7	688336	三生国健	2,552,441.37	22.44
8	002422	科伦药业	2,445,568.00	21.50
9	300890	翔丰华	2,387,019.00	20.98
10	301033	迈普医学	2,243,500.00	19.72
11	688235	百济神州	2,173,528.10	19.10
12	300347	泰格医药	2,122,666.00	18.66
13	300430	诚益通	2,115,098.00	18.59

14	688687	凯因科技	2,102,118.64	18.48
15	002226	江南化工	2,078,642.00	18.27
16	002019	亿帆医药	2,049,554.00	18.02
17	002773	康弘药业	1,966,498.00	17.29
18	688566	吉贝尔	1,884,639.19	16.57
19	688253	英诺特	1,820,869.08	16.00
20	600085	同仁堂	1,752,255.00	15.40
21	688613	奥精医疗	1,693,000.73	14.88
22	688197	首药控股	1,680,703.96	14.77
23	603676	卫信康	1,649,864.00	14.50
24	300457	赢合科技	1,640,730.00	14.42
25	688506	百利天恒	1,639,595.63	14.41
26	002044	美年健康	1,616,210.00	14.21
27	600511	国药股份	1,602,618.00	14.09
28	688799	华纳药厂	1,596,937.26	14.04
29	688177	百奥泰	1,558,809.96	13.70
30	000426	兴业银锡	1,556,640.00	13.68
31	603882	金域医学	1,551,942.00	13.64
32	002428	云南锗业	1,538,685.00	13.52
33	688358	祥生医疗	1,517,490.84	13.34
34	688266	泽璟制药	1,503,329.59	13.21
35	301230	泓博医药	1,494,481.00	13.14
36	600557	康缘药业	1,472,080.00	12.94
37	301257	普蕊斯	1,469,320.00	12.91
38	688981	中芯国际	1,468,221.67	12.91
39	300233	金城医药	1,437,065.00	12.63
40	688593	新相微	1,407,686.98	12.37
41	688428	诺诚健华	1,400,362.96	12.31
42	002755	奥赛康	1,357,437.00	11.93
43	688152	麒麟信安	1,349,334.24	11.86
44	688581	安杰思	1,318,074.92	11.59

45	301085	亚康股份	1,301,811.00	11.44
46	301149	隆华新材	1,278,019.00	11.23
47	603456	九洲药业	1,248,733.00	10.98
48	688196	卓越新能	1,246,578.24	10.96
49	603567	珍宝岛	1,246,509.00	10.96
50	600276	恒瑞医药	1,213,463.00	10.67
51	603222	济民健康	1,182,754.00	10.40
52	300049	福瑞股份	1,176,000.00	10.34
53	300396	迪瑞医疗	1,161,971.00	10.21
54	600212	绿能慧充	1,103,810.00	9.70
55	300529	健帆生物	1,101,415.00	9.68
56	301459	丰茂股份	1,092,053.00	9.60
57	600216	浙江医药	1,080,014.00	9.49
58	603799	华友钴业	1,071,796.00	9.42
59	301015	百洋医药	1,063,991.00	9.35
60	603214	爱婴室	1,063,012.00	9.34
61	603198	迎驾贡酒	1,037,519.00	9.12
62	601677	明泰铝业	1,016,395.00	8.93
63	688068	热景生物	1,010,376.51	8.88
64	688139	海尔生物	1,004,409.98	8.83
65	600079	人福医药	1,002,376.50	8.81
66	688499	利元亨	998,317.21	8.77
67	002589	瑞康医药	997,606.00	8.77
68	600129	太极集团	997,344.00	8.77
69	301096	百诚医药	990,519.00	8.71
70	605507	国邦医药	967,893.44	8.51
71	605116	奥锐特	963,726.00	8.47
72	002299	圣农发展	963,564.00	8.47
73	688131	皓元医药	961,149.52	8.45
74	688260	昀冢科技	940,885.52	8.27
75	603108	润达医疗	935,006.00	8.22

76	688321	微芯生物	927,676.24	8.15
77	002987	京北方	920,839.00	8.09
78	603309	维力医疗	910,925.80	8.01
79	603998	方盛制药	892,573.00	7.85
80	688133	泰坦科技	883,080.89	7.76
81	688503	聚和材料	882,082.98	7.75
82	688059	华锐精密	880,100.47	7.74
83	688629	华丰科技	877,784.82	7.72
84	688276	百克生物	877,188.70	7.71
85	300785	值得买	874,027.00	7.68
86	600336	澳柯玛	861,153.00	7.57
87	000028	国药一致	848,968.00	7.46
88	603036	如通股份	847,657.00	7.45
89	688108	赛诺医疗	842,164.45	7.40
90	300122	智飞生物	836,474.00	7.35
91	688062	迈威生物	834,043.24	7.33
92	688410	山外山	823,664.32	7.24
93	603067	振华股份	822,566.00	7.23
94	002597	金禾实业	815,956.00	7.17
95	300975	商络电子	808,645.00	7.11
96	300121	阳谷华泰	808,248.00	7.10
97	603127	昭衍新药	807,093.60	7.09
98	688669	聚石化学	804,253.26	7.07
99	000403	派林生物	801,301.00	7.04
100	000521	长虹美菱	774,389.00	6.81
101	601388	怡球资源	759,331.00	6.67
102	000932	华菱钢铁	749,387.00	6.59
103	300247	融捷健康	742,804.00	6.53
104	688578	艾力斯	738,285.61	6.49
105	002869	金溢科技	731,626.00	6.43
106	600820	隧道股份	724,025.00	6.36

107	603605	珀莱雅	723,906.00	6.36
108	002991	甘源食品	719,388.00	6.32
109	600019	宝钢股份	718,105.00	6.31
110	688382	益方生物	710,947.05	6.25
111	600566	济川药业	705,222.00	6.20
112	600479	千金药业	703,581.00	6.18
113	002664	信质集团	674,557.00	5.93
114	688378	奥来德	673,549.75	5.92
115	600833	第一医药	670,765.00	5.90
116	300130	新国都	670,247.00	5.89
117	688561	奇安信	670,222.80	5.89
118	688338	赛科希德	667,535.01	5.87
119	688016	心脉医疗	655,806.15	5.76
120	688236	春立医疗	654,962.10	5.76
121	688121	卓然股份	654,647.17	5.75
122	603988	中电电机	646,400.00	5.68
123	002129	TCL中环	642,988.00	5.65
124	600295	鄂尔多斯	635,107.80	5.58
125	000032	深桑达 A	632,897.00	5.56
126	002332	仙琚制药	627,895.00	5.52
127	300735	光弘科技	622,903.00	5.48
128	688159	有方科技	612,037.09	5.38
129	002432	九安医疗	603,115.00	5.30
130	688520	神州细胞	598,565.08	5.26
131	688029	南微医学	593,958.34	5.22
132	300857	协创数据	593,861.00	5.22
133	002780	三夫户外	593,547.00	5.22
134	688303	大全能源	591,129.62	5.20
135	688314	康拓医疗	588,661.13	5.17
136	605186	健麾信息	588,201.00	5.17
137	300206	理邦仪器	587,937.00	5.17

138	300759	康龙化成	585,717.00	5.15
139	002192	融捷股份	583,971.00	5.13
140	603477	巨星农牧	579,225.00	5.09
141	600521	华海药业	573,757.00	5.04
142	300562	乐心医疗	566,613.00	4.98
143	002765	蓝黛科技	562,009.00	4.94
144	002275	桂林三金	560,812.00	4.93
145	000997	新大陆	560,625.98	4.93
146	688390	固德威	560,040.84	4.92
147	600346	恒力石化	556,768.00	4.89
148	688733	壹石通	554,398.02	4.87
149	002151	北斗星通	552,603.00	4.86
150	688192	迪哲医药	544,541.73	4.79
151	002817	黄山胶囊	535,511.00	4.71
152	300298	三诺生物	533,300.00	4.69
153	688256	寒武纪	530,405.05	4.66
154	301091	深城交	529,253.00	4.65
155	688612	威迈斯	528,512.61	4.65
156	603987	康德莱	516,944.00	4.54
157	300009	安科生物	515,887.00	4.53
158	603005	晶方科技	515,743.00	4.53
159	601607	上海医药	514,834.00	4.53
160	603518	锦泓集团	505,324.00	4.44
161	600332	白云山	504,556.00	4.43
162	688591	泰凌微	504,424.38	4.43
163	600888	新疆众和	498,852.00	4.38
164	000977	浪潮信息	495,052.00	4.35
165	000803	山高环能	490,788.00	4.31
166	001223	欧克科技	486,616.00	4.28
167	301383	天键股份	486,104.00	4.27
168	605266	健之佳	481,338.00	4.23

169	300677	英科医疗	478,100.00	4.20
170	002045	国光电器	477,608.00	4.20
171	600062	华润双鹤	477,228.00	4.19
172	601186	中国铁建	476,768.00	4.19
173	603688	石英股份	475,573.50	4.18
174	300109	新开源	475,109.00	4.18
175	002567	唐人神	471,576.00	4.15
176	000425	徐工机械	469,943.00	4.13
177	300666	江丰电子	468,915.00	4.12
178	002821	凯莱英	468,763.00	4.12
179	603896	寿仙谷	468,008.00	4.11
180	600789	鲁抗医药	467,001.45	4.10
181	600771	广誉远	453,183.00	3.98
182	600721	百花医药	452,157.00	3.97
183	300003	乐普医疗	451,958.00	3.97
184	002128	电投能源	451,071.00	3.96
185	688172	燕东微	449,108.34	3.95
186	688046	药康生物	440,387.45	3.87
187	300763	锦浪科技	438,580.00	3.86
188	300406	九强生物	433,658.10	3.81
189	301027	华蓝集团	431,360.00	3.79
190	688180	君实生物	427,448.25	3.76
191	300364	中文在线	425,217.00	3.74
192	301126	达嘉维康	422,166.00	3.71
193	002011	盾安环境	421,420.00	3.70
194	603369	今世缘	420,735.00	3.70
195	000628	高新发展	414,161.00	3.64
196	688308	欧科亿	408,365.08	3.59
197	300981	中红医疗	408,066.00	3.59
198	603168	莎普爱思	407,153.00	3.58
199	002832	比音勒芬	405,202.00	3.56

200	688361	中科飞测	400,189.13	3.52
201	301122	采纳股份	394,875.70	3.47
202	603233	大参林	394,571.00	3.47
203	301413	安培龙	390,811.00	3.44
204	000923	河钢资源	377,996.00	3.32
205	301608	博实结	377,208.00	3.32
206	603599	广信股份	373,079.00	3.28
207	600993	马应龙	369,893.00	3.25
208	301127	天源环保	368,661.00	3.24
209	601567	三星医疗	368,553.00	3.24
210	300596	利安隆	367,337.00	3.23
211	300683	海特生物	365,555.00	3.21
212	688249	晶合集成	358,824.72	3.15
213	600419	天润乳业	357,705.00	3.14
214	300725	药石科技	356,649.00	3.13
215	300896	爱美客	353,266.04	3.11
216	600057	厦门象屿	351,326.00	3.09
217	605366	宏柏新材	348,344.06	3.06
218	600535	天士力	347,210.00	3.05
219	000999	华润三九	344,497.00	3.03
220	600749	西藏旅游	344,224.00	3.03
221	301367	怡和嘉业	343,739.00	3.02
222	601766	中国中车	342,616.00	3.01
223	600761	安徽合力	341,181.00	3.00
224	688393	安必平	340,993.74	3.00
225	688472	阿特斯	340,895.23	3.00
226	601633	长城汽车	340,542.00	2.99
227	600219	南山铝业	340,376.00	2.99
228	601800	中国交建	339,681.00	2.99
229	300627	华测导航	337,846.00	2.97
230	603496	恒为科技	336,899.00	2.96

231	002791	坚朗五金	336,653.00	2.96
232	601618	中国中冶	335,475.00	2.95
233	600970	中材国际	334,504.00	2.94
234	000520	凤凰航运	331,789.00	2.92
235	600096	云天化	330,461.00	2.90
236	600285	羚锐制药	330,135.00	2.90
237	688600	皖仪科技	328,084.03	2.88
238	688035	德邦科技	325,862.01	2.86
239	600531	豫光金铅	325,472.00	2.86
240	002085	万丰奥威	325,041.00	2.86
241	002223	鱼跃医疗	321,994.00	2.83
242	002419	天虹股份	320,421.00	2.82
243	000034	神州数码	319,868.00	2.81
244	002172	澳洋健康	319,532.00	2.81
245	603019	中科曙光	319,200.00	2.81
246	600976	健民集团	319,171.00	2.81
247	688515	裕太微	313,460.93	2.76
248	000737	北方铜业	312,893.00	2.75
249	002466	天齐锂业	312,399.00	2.75
250	002170	芭田股份	312,027.00	2.74
251	600990	四创电子	312,003.00	2.74
252	002603	以岭药业	311,870.00	2.74
253	002897	意华股份	310,791.00	2.73
254	002236	大华股份	310,440.00	2.73
255	688575	亚辉龙	310,174.48	2.73
256	688073	毕得医药	309,939.78	2.72
257	600867	通化东宝	309,688.00	2.72
258	688010	福光股份	308,321.55	2.71
259	000338	潍柴动力	308,277.00	2.71
260	300919	中伟股份	308,257.00	2.71
261	301429	森泰股份	307,846.00	2.71

262	601669	中国电建	307,678.00	2.70
263	688111	金山办公	307,055.28	2.70
264	000960	锡业股份	307,005.00	2.70
265	603339	四方科技	306,921.00	2.70
266	600030	中信证券	306,616.00	2.70
267	600887	伊利股份	306,510.00	2.69
268	600415	小商品城	306,421.00	2.69
269	603032	德新科技	304,794.00	2.68
270	000021	深科技	304,714.00	2.68
271	301528	多浦乐	304,470.00	2.68
272	600426	华鲁恒升	304,309.00	2.67
273	300589	江龙船艇	303,001.00	2.66
274	000963	华东医药	302,712.00	2.66
275	600490	鹏欣资源	301,893.00	2.65
276	300246	宝莱特	297,543.00	2.62
277	002837	英维克	295,835.80	2.60
278	300724	捷佳伟创	295,634.00	2.60
279	300922	天秦装备	293,914.00	2.58
280	000063	中兴通讯	293,480.00	2.58
281	000553	安道麦A	293,313.00	2.58
282	600035	楚天高速	293,220.00	2.58
283	002156	通富微电	292,423.00	2.57
284	300383	光环新网	292,026.00	2.57
285	688626	翔宇医疗	291,861.11	2.57
286	300143	盈康生命	290,669.00	2.55
287	002541	鸿路钢构	290,203.00	2.55
288	002622	皓宸医疗	289,765.00	2.55
289	688153	唯捷创芯	289,697.75	2.55
290	300015	爱尔眼科	289,362.00	2.54
291	603083	剑桥科技	288,953.00	2.54
292	688535	华海诚科	288,312.12	2.53

293	002648	卫星化学	288,296.00	2.53
294	300168	万达信息	284,040.00	2.50
295	603345	安井食品	283,934.00	2.50
296	603612	索通发展	283,437.00	2.49
297	300019	硅宝科技	280,814.00	2.47
298	600961	株冶集团	280,656.00	2.47
299	003000	劲仔食品	280,642.00	2.47
300	688311	盟升电子	279,737.89	2.46
301	300861	美畅股份	277,315.00	2.44
302	601028	玉龙股份	275,810.00	2.42
303	301050	雷电微力	275,039.00	2.42
304	603269	海鸥股份	273,436.00	2.40
305	600865	百大集团	273,404.00	2.40
306	003005	竞业达	273,083.00	2.40
307	000066	中国长城	272,218.00	2.39
308	301160	翔楼新材	271,308.00	2.38
309	600502	安徽建工	271,220.00	2.38
310	000928	中钢国际	271,145.00	2.38
311	688202	美迪西	267,918.26	2.35
312	300026	红日药业	267,586.00	2.35
313	300765	新诺威	266,962.00	2.35
314	605589	圣泉集团	266,467.00	2.34
315	600657	信达地产	266,199.00	2.34
316	688448	磁谷科技	263,791.64	2.32
317	002677	浙江美大	263,725.00	2.32
318	301018	申菱环境	263,599.00	2.32
319	002261	拓维信息	263,102.00	2.31
320	603236	移远通信	262,620.00	2.31
321	300401	花园生物	261,784.00	2.30
322	000921	海信家电	261,104.00	2.30
323	688596	正帆科技	259,253.14	2.28

324	601390	中国中铁	257,915.00	2.27
325	300547	川环科技	257,853.00	2.27
326	601668	中国建筑	256,418.00	2.25
327	300286	安科瑞	255,497.00	2.25
328	001314	亿道信息	255,392.00	2.24
329	002412	汉森制药	254,254.00	2.23
330	300673	佩蒂股份	253,786.00	2.23
331	688348	昱能科技	253,579.50	2.23
332	300166	东方国信	252,968.00	2.22
333	600765	中航重机	252,368.00	2.22
334	688630	芯碁微装	252,242.88	2.22
335	002950	奥美医疗	252,072.00	2.22
336	600879	航天电子	251,944.00	2.21
337	601699	潞安环能	251,092.00	2.21
338	601898	中煤能源	249,238.00	2.19
339	601001	晋控煤业	248,916.00	2.19
340	300260	新莱应材	248,770.00	2.19
341	603801	志邦家居	248,324.00	2.18
342	300227	光韵达	246,043.00	2.16
343	300161	华中数控	245,427.00	2.16
344	300760	迈瑞医疗	245,089.00	2.15
345	300490	华自科技	244,216.00	2.15
346	002536	飞龙股份	243,972.00	2.14
347	600428	中远海特	243,372.00	2.14
348	601336	新华保险	243,335.00	2.14
349	688592	司南导航	243,310.34	2.14
350	603667	五洲新春	241,272.00	2.12
351	300522	世名科技	239,587.00	2.11
352	688658	悦康药业	238,698.30	2.10
353	002852	道道全	238,146.00	2.09
354	603181	皇马科技	236,321.00	2.08

355	002986	宇新股份	235,931.00	2.07
356	301520	万邦医药	235,381.48	2.07
357	300451	创业慧康	234,701.00	2.06
358	605088	冠盛股份	232,789.00	2.05
359	300243	瑞丰高材	230,888.00	2.03
360	601319	中国人保	229,791.00	2.02
361	301097	天益医疗	229,300.00	2.02
362	300039	上海凯宝	229,171.00	2.01
363	688091	上海谊众	228,662.25	2.01

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

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	301236	软通动力	4,584,244.00	40.29
2	603259	药明康德	3,944,257.60	34.67
3	688443	智翔金泰	3,153,897.31	27.72
4	002422	科伦药业	2,905,857.29	25.54
5	300719	安达维尔	2,809,948.00	24.70
6	688166	博瑞医药	2,797,801.03	24.59
7	300430	诚益通	2,697,043.60	23.71
8	002019	亿帆医药	2,678,993.00	23.55
9	688336	三生国健	2,635,474.92	23.17
10	688235	百济神州	2,571,868.17	22.61
11	688621	阳光诺和	2,544,198.97	22.36
12	301033	迈普医学	2,463,824.85	21.66
13	002773	康弘药业	2,400,083.00	21.10
14	300890	翔丰华	2,357,771.00	20.72
15	002226	江南化工	2,074,308.00	18.23

16	300347	泰格医药	2,057,419.00	18.08
17	688687	凯因科技	2,023,376.68	17.78
18	688266	泽璟制药	1,954,124.81	17.18
19	688566	吉贝尔	1,929,578.31	16.96
20	688253	英诺特	1,891,635.60	16.63
21	301257	普蕊斯	1,777,859.00	15.63
22	301230	泓博医药	1,753,562.00	15.41
23	600085	同仁堂	1,723,915.00	15.15
24	300049	福瑞股份	1,702,413.00	14.96
25	688506	百利天恒	1,675,403.78	14.73
26	002044	美年健康	1,660,780.00	14.60
27	603676	卫信康	1,657,409.00	14.57
28	688799	华纳药厂	1,610,850.01	14.16
29	301096	百诚医药	1,608,415.00	14.14
30	688428	诺诚健华	1,607,909.45	14.13
31	300457	赢合科技	1,603,010.00	14.09
32	603882	金域医学	1,592,061.00	13.99
33	688197	首药控股	1,584,189.91	13.92
34	600511	国药股份	1,583,886.00	13.92
35	600557	康缘药业	1,583,124.00	13.92
36	000426	兴业银锡	1,573,311.00	13.83
37	688177	百奥泰	1,490,335.92	13.10
38	002428	云南锗业	1,475,366.00	12.97
39	300233	金城医药	1,455,697.00	12.80
40	688593	新相微	1,445,780.41	12.71
41	603198	迎驾贡酒	1,440,983.00	12.67
42	688613	奥精医疗	1,365,203.70	12.00
43	002755	奥赛康	1,355,688.10	11.92
44	000028	国药一致	1,298,932.90	11.42
45	688152	麒麟信安	1,296,691.91	11.40
46	603456	九洲药业	1,284,784.00	11.29

47	688581	安杰思	1,280,756.97	11.26
48	301085	亚康股份	1,266,150.58	11.13
49	688358	祥生医疗	1,252,771.56	11.01
50	301149	隆华新材	1,251,724.00	11.00
51	600276	恒瑞医药	1,206,881.00	10.61
52	603222	济民健康	1,204,393.00	10.59
53	603567	珍宝岛	1,196,234.00	10.51
54	688196	卓越新能	1,154,710.43	10.15
55	688981	中芯国际	1,152,784.69	10.13
56	600216	浙江医药	1,115,231.00	9.80
57	300529	健帆生物	1,106,852.00	9.73
58	300396	迪瑞医疗	1,102,071.00	9.69
59	688139	海尔生物	1,099,422.36	9.66
60	600212	绿能慧充	1,080,015.00	9.49
61	603799	华友钴业	1,057,092.00	9.29
62	301459	丰茂股份	1,053,778.93	9.26
63	600129	太极集团	1,033,718.00	9.09
64	002589	瑞康医药	1,031,248.00	9.06
65	601677	明泰铝业	1,029,903.00	9.05
66	605116	奥锐特	1,016,066.00	8.93
67	600079	人福医药	1,003,182.00	8.82
68	605507	国邦医药	969,302.68	8.52
69	002987	京北方	956,129.00	8.40
70	688629	华丰科技	953,423.83	8.38
71	688131	皓元医药	936,042.72	8.23
72	688321	微芯生物	925,544.24	8.14
73	300785	值得买	909,998.00	8.00
74	300975	商络电子	906,504.11	7.97
75	002299	圣农发展	906,020.00	7.96
76	600336	澳柯玛	903,947.00	7.95
77	688260	昀冢科技	897,540.73	7.89

78	603998	方盛制药	897,260.00	7.89
79	300857	协创数据	896,150.00	7.88
80	603309	维力医疗	892,089.00	7.84
81	688108	赛诺医疗	878,971.23	7.73
82	688068	热景生物	874,127.25	7.68
83	301383	天键股份	873,453.70	7.68
84	603036	如通股份	870,991.00	7.66
85	688276	百克生物	870,675.81	7.65
86	603067	振华股份	866,636.00	7.62
87	688499	利元亨	845,104.65	7.43
88	688059	华锐精密	845,077.71	7.43
89	688133	泰坦科技	841,719.65	7.40
90	002597	金禾实业	835,963.00	7.35
91	688180	君实生物	832,461.51	7.32
92	688669	聚石化学	823,258.90	7.24
93	603214	爱婴室	811,250.00	7.13
94	688382	益方生物	806,044.15	7.08
95	000403	派林生物	804,788.00	7.07
96	688578	艾力斯	801,401.71	7.04
97	300121	阳谷华泰	799,946.00	7.03
98	603605	珀莱雅	799,756.00	7.03
99	603108	润达医疗	797,087.00	7.01
100	300122	智飞生物	790,429.00	6.95
101	603127	昭衍新药	787,938.40	6.93
102	000521	长虹美菱	776,917.00	6.83
103	002869	金溢科技	752,320.00	6.61
104	300247	融捷健康	746,132.00	6.56
105	000932	华菱钢铁	736,104.00	6.47
106	601388	怡球资源	725,622.00	6.38
107	301015	百洋医药	720,626.00	6.33
108	688062	迈威生物	716,419.90	6.30

109	002991	甘源食品	714,804.00	6.28
110	600019	宝钢股份	707,183.00	6.22
111	600820	隧道股份	693,661.00	6.10
112	603988	中电电机	681,356.00	5.99
113	002664	信质集团	672,405.00	5.91
114	002129	TCL中环	672,225.00	5.91
115	600479	千金药业	661,094.00	5.81
116	600566	济川药业	660,951.00	5.81
117	688303	大全能源	648,019.55	5.70
118	600295	鄂尔多斯	647,727.00	5.69
119	300735	光弘科技	646,704.00	5.68
120	688338	赛科希德	644,309.66	5.66
121	688236	春立医疗	644,014.37	5.66
122	605186	健麾信息	642,990.00	5.65
123	688378	奥来德	641,268.74	5.64
124	002332	仙琚制药	636,883.00	5.60
125	688503	聚和材料	630,623.64	5.54
126	688561	奇安信	628,759.36	5.53
127	300130	新国都	627,058.00	5.51
128	600833	第一医药	626,764.00	5.51
129	300206	理邦仪器	619,681.00	5.45
130	300759	康龙化成	606,180.00	5.33
131	688256	寒武纪	596,698.77	5.24
132	688121	卓然股份	595,979.72	5.24
133	688314	康拓医疗	593,879.20	5.22
134	688159	有方科技	583,577.41	5.13
135	688029	南微医学	582,302.33	5.12
136	002432	九安医疗	579,259.00	5.09
137	300298	三诺生物	579,201.00	5.09
138	688016	心脉医疗	577,382.98	5.08
139	688520	神州细胞	576,442.35	5.07

140	688410	山外山	572,840.83	5.04
141	002275	桂林三金	569,622.00	5.01
142	688733	壹石通	569,418.21	5.01
143	603477	巨星农牧	564,839.00	4.96
144	688192	迪哲医药	564,132.91	4.96
145	600346	恒力石化	558,916.00	4.91
146	603987	康德莱	555,290.00	4.88
147	002192	融捷股份	554,955.00	4.88
148	300314	戴维医疗	549,129.00	4.83
149	688390	固德威	544,051.89	4.78
150	688591	泰凌微	540,664.01	4.75
151	300562	乐心医疗	537,820.00	4.73
152	603005	晶方科技	531,155.00	4.67
153	601607	上海医药	529,811.00	4.66
154	688612	威迈斯	529,136.96	4.65
155	002151	北斗星通	524,086.00	4.61
156	600771	广誉远	510,542.00	4.49
157	601089	福元医药	503,847.00	4.43
158	600888	新疆众和	499,924.00	4.39
159	300009	安科生物	498,990.00	4.39
160	301091	深城交	498,636.00	4.38
161	600332	白云山	495,037.00	4.35
162	603518	锦泓集团	492,625.00	4.33
163	300666	江丰电子	484,234.00	4.26
164	600789	鲁抗医药	481,314.00	4.23
165	000803	山高环能	480,620.00	4.22
166	000425	徐工机械	480,608.00	4.22
167	002128	电投能源	478,948.00	4.21
168	603896	寿仙谷	476,272.00	4.19
169	001223	欧克科技	473,807.00	4.16
170	002817	黄山胶囊	473,750.00	4.16

171	300109	新开源	471,210.00	4.14
172	603688	石英股份	465,817.00	4.09
173	600062	华润双鹤	465,717.00	4.09
174	002567	唐人神	464,677.00	4.08
175	000628	高新发展	464,652.00	4.08
176	300677	英科医疗	463,742.00	4.08
177	605266	健之佳	463,381.00	4.07
178	002821	凯莱英	453,904.00	3.99
179	601186	中国铁建	450,655.00	3.96
180	600721	百花医药	448,438.00	3.94
181	000977	浪潮信息	446,463.00	3.92
182	301027	华蓝集团	444,651.00	3.91
183	002011	盾安环境	433,338.00	3.81
184	300364	中文在线	432,140.00	3.80
185	688046	药康生物	431,924.80	3.80
186	301126	达嘉维康	425,530.00	3.74
187	300763	锦浪科技	424,057.00	3.73
188	300003	乐普医疗	411,950.00	3.62
189	300406	九强生物	409,181.75	3.60
190	603168	莎普爱思	408,256.00	3.59
191	603369	今世缘	407,702.00	3.58
192	002832	比音勒芬	402,736.00	3.54
193	301413	安培龙	400,677.00	3.52
194	000737	北方铜业	399,464.00	3.51
195	688172	燕东微	398,857.86	3.51
196	688361	中科飞测	397,119.80	3.49
197	601567	三星医疗	394,570.00	3.47
198	688308	欧科亿	391,477.77	3.44
199	300981	中红医疗	382,501.00	3.36
200	301122	采纳股份	382,414.60	3.36
201	688249	晶合集成	372,306.85	3.27

202	300596	利安隆	367,184.00	3.23
203	600749	西藏旅游	366,954.00	3.23
204	603233	大参林	366,736.00	3.22
205	603599	广信股份	362,281.40	3.18
206	688515	裕太微	361,854.24	3.18
207	600993	马应龙	360,262.00	3.17
208	300683	海特生物	358,996.00	3.16
209	000520	凤凰航运	357,964.00	3.15
210	603496	恒为科技	356,994.60	3.14
211	603083	剑桥科技	354,719.00	3.12
212	600285	羚锐制药	354,034.00	3.11
213	605366	宏柏新材	354,017.00	3.11
214	301608	博实结	350,611.00	3.08
215	300725	药石科技	349,707.00	3.07
216	600057	厦门象屿	349,266.00	3.07
217	688575	亚辉龙	348,163.22	3.06
218	600418	江淮汽车	347,652.00	3.06
219	000066	中国长城	347,468.00	3.05
220	000999	华润三九	346,484.00	3.05
221	000923	河钢资源	346,332.00	3.04
222	600976	健民集团	345,570.00	3.04
223	600535	天士力	341,658.00	3.00
224	300896	爱美客	341,000.00	3.00
225	600761	安徽合力	339,879.00	2.99
226	000032	深桑达 A	339,505.00	2.98
227	600219	南山铝业	339,111.00	2.98
228	002897	意华股份	338,198.00	2.97
229	601766	中国中车	337,484.00	2.97
230	601800	中国交建	335,036.00	2.94
231	002791	坚朗五金	333,814.00	2.93
232	600531	豫光金铅	331,883.00	2.92

233	600096	云天化	329,236.00	2.89
234	601633	长城汽车	328,693.00	2.89
235	002419	天虹股份	328,346.00	2.89
236	000063	中兴通讯	326,733.00	2.87
237	300547	川环科技	326,093.00	2.87
238	688626	翔宇医疗	325,467.09	2.86
239	000997	新大陆	324,663.00	2.85
240	688472	阿特斯	323,962.28	2.85
241	002261	拓维信息	323,574.00	2.84
242	301367	怡和嘉业	320,194.00	2.81
243	300627	华测导航	318,522.00	2.80
244	688393	安必平	318,429.69	2.80
245	000034	神州数码	318,108.00	2.80
246	300762	上海瀚讯	316,883.00	2.79
247	002223	鱼跃医疗	316,373.00	2.78
248	601618	中国中冶	314,560.00	2.76
249	600990	四创电子	313,082.00	2.75
250	688600	皖仪科技	312,964.38	2.75
251	603019	中科曙光	312,700.00	2.75
252	600415	小商品城	312,663.00	2.75
253	300919	中伟股份	311,480.00	2.74
254	300589	江龙船艇	310,152.00	2.73
255	600867	通化东宝	309,852.00	2.72
256	600030	中信证券	309,622.70	2.72
257	002603	以岭药业	308,149.00	2.71
258	002466	天齐锂业	307,681.00	2.70
259	601669	中国电建	307,398.00	2.70
260	000960	锡业股份	306,756.00	2.70
261	600887	伊利股份	305,760.00	2.69
262	301018	申菱环境	305,694.00	2.69
263	300143	盈康生命	305,070.00	2.68

264	000963	华东医药	304,722.00	2.68
265	002236	大华股份	302,787.00	2.66
266	301127	天源环保	302,339.00	2.66
267	002085	万丰奥威	302,161.00	2.66
268	603032	德新科技	300,355.85	2.64
269	002541	鸿路钢构	300,133.40	2.64
270	002172	澳洋健康	299,602.00	2.63
271	600426	华鲁恒升	299,454.00	2.63
272	600970	中材国际	299,031.00	2.63
273	002170	芭田股份	298,762.00	2.63
274	000021	深科技	297,575.00	2.62
275	301528	多浦乐	297,478.00	2.61
276	688010	福光股份	297,434.59	2.61
277	002156	通富微电	297,412.00	2.61
278	600657	信达地产	297,286.00	2.61
279	688111	金山办公	294,320.79	2.59
280	300724	捷佳伟创	293,121.00	2.58
281	600961	株冶集团	292,513.00	2.57
282	002837	英维克	291,538.00	2.56
283	603339	四方科技	290,630.00	2.55
284	003000	劲仔食品	290,025.00	2.55
285	300015	爱尔眼科	289,772.00	2.55
286	600521	华海药业	289,250.00	2.54
287	000338	潍柴动力	288,536.00	2.54
288	688073	毕得医药	288,126.91	2.53
289	300246	宝莱特	288,009.00	2.53
290	300765	新诺威	287,827.00	2.53
291	002765	蓝黛科技	287,379.00	2.53
292	002780	三夫户外	287,289.00	2.53
293	688035	德邦科技	285,577.45	2.51
294	688535	华海诚科	283,273.55	2.49

295	300161	华中数控	282,500.00	2.48
296	600035	楚天高速	278,740.00	2.45
297	688202	美迪西	278,372.35	2.45
298	688311	盟升电子	278,006.62	2.44
299	601336	新华保险	277,500.00	2.44
300	603823	百合花	277,188.00	2.44
301	603667	五洲新春	275,535.00	2.42
302	601699	潞安环能	274,093.00	2.41
303	002648	卫星化学	274,000.00	2.41
304	600502	安徽建工	273,280.00	2.40
305	300168	万达信息	273,212.00	2.40
306	000553	安道麦A	271,573.00	2.39
307	002622	皓宸医疗	271,000.00	2.38
308	603612	索通发展	270,881.00	2.38
309	300861	美畅股份	269,583.00	2.37
310	605589	圣泉集团	269,369.00	2.37
311	601028	玉龙股份	268,427.00	2.36
312	688596	正帆科技	267,852.46	2.35
313	603345	安井食品	267,291.00	2.35
314	601001	晋控煤业	264,960.00	2.33
315	300760	迈瑞医疗	264,663.00	2.33
316	003005	竞业达	263,202.00	2.31
317	600490	鹏欣资源	263,132.00	2.31
318	002045	国光电器	262,339.00	2.31
319	001314	亿道信息	261,992.00	2.30
320	301050	雷电微力	261,836.00	2.30
321	300383	光环新网	261,476.00	2.30
322	300019	硅宝科技	260,402.00	2.29
323	000928	中钢国际	260,035.00	2.29
324	601898	中煤能源	259,435.00	2.28
325	601668	中国建筑	258,229.00	2.27

326	300026	红日药业	258,085.00	2.27
327	300922	天秦装备	256,928.00	2.26
328	600879	航天电子	256,717.00	2.26
329	301160	翔楼新材	255,972.00	2.25
330	000921	海信家电	255,618.00	2.25
331	002412	汉森制药	253,894.00	2.23
332	301429	森泰股份	253,749.00	2.23
333	603181	皇马科技	249,876.00	2.20
334	002950	奥美医疗	249,678.00	2.19
335	603236	移远通信	248,873.00	2.19
336	600765	中航重机	247,677.00	2.18
337	300166	东方国信	247,091.00	2.17
338	603269	海鸥股份	246,811.60	2.17
339	300286	安科瑞	246,168.00	2.16
340	300673	佩蒂股份	245,527.00	2.16
341	002677	浙江美大	244,194.00	2.15
342	688348	昱能科技	244,010.90	2.14
343	688448	磁谷科技	243,313.15	2.14
344	300243	瑞丰高材	243,080.00	2.14
345	601390	中国中铁	242,697.00	2.13
346	300227	光韵达	240,109.00	2.11
347	600428	中远海特	239,435.00	2.10
348	688630	芯碁微装	238,857.70	2.10
349	688332	中科蓝讯	238,111.01	2.09
350	601319	中国人保	237,626.00	2.09
351	300260	新莱应材	237,450.00	2.09
352	603801	志邦家居	236,914.00	2.08
353	688592	司南导航	236,416.83	2.08
354	002986	宇新股份	235,497.00	2.07
355	002536	飞龙股份	235,045.00	2.07
356	300522	世名科技	234,925.00	2.06

357	300401	花园生物	234,840.00	2.06
358	688658	悦康药业	233,523.06	2.05
359	605088	冠盛股份	233,272.00	2.05
360	688153	唯捷创芯	231,625.49	2.04
361	603508	思维列控	228,514.00	2.01

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	260,399,540.75
卖出股票收入（成交）总额	263,233,002.81

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

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	406,826.79	5.60
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	406,826.79	5.60

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	019698	23国债05	2,000	204,300.00	2.81
2	019740	24国债09	2,000	202,526.79	2.79

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 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	16,764.05
2	应收清算款	272,126.99
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	21,641.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	310,532.69

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

本基金本报告期末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有尾差。

§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 福康 混合A	501	9,481.44	2,777,587.24	58.473%	1,972,613.79	41.527%
富荣 福康 混合C	973	4,206.75	2,468,110.55	60.2983%	1,625,054.72	39.7017%
合计	1,391	6,357.56	5,245,697.79	59.3179%	3,597,668.51	40.6821%

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	富荣福康混合A	40,534.31	0.85%
	富荣福康混合C	117.42	0.00%
	合计	40,651.73	0.46%

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。

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	富荣福康混合A	0
	富荣福康混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富荣福康混合A	0~10
	富荣福康混合C	0~10
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣福康混合A	富荣福康混合C
基金合同生效日(2018年02月11日)基金份额总额	44,615,915.86	159,005,805.56
本报告期期初基金份额总额	2,244,509.61	9,996,314.68

本报告期基金总申购份额	3,038,155.39	11,858,643.40
减：本报告期基金总赎回份额	532,463.97	17,761,792.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,750,201.03	4,093,165.27

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

1、基金管理人公告以通讯方式组织召开富荣福康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2024年1月3日起，至2024年1月31日17:00止，并于2024年2月1日审议通过了《关于富荣福康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、基金管理人公告以通讯方式组织召开富荣福康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2024年10月1日起，至2024年11月3日17:00止，并于2024年11月4日审议通过了《关于富荣福康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、任晓伟自2024年11月6日起卸任督察长职务，总经理杨小舟自2024年11月6日起代行督察长职务。

2、郑宇光自2024年12月2日起担任总经理助理职务。

3、赵睿杨自2024年12月2日起担任总经理助理职务。

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7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	管理人及其高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年12月27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	个别私募资产管理计划未严格执行个别规定及内部制度
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，已按相关要求进行全面整改并已将整改落实情况报送监管机构，整改措施包括完善内部制度及相关工作流程等
其他	-

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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	1	227,350,067.52	43.42%	142,593.55	44.45%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

中国 国际 金融	1	80,389,160.57	15.35%	61,570.42	19.19%	-
广发 证券	2	215,893,315.47	41.23%	116,610.56	36.35%	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-

注：（1）证券公司的选择标准为财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。（2）证券公司的选择程序为根据标准进行考察、准入后，经公司批准后与被选择的证券公司签订协议。（3）报告期内证券交易单元退租金元证券、方正证券、中信证券席位。（4）《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自2024年7月1日生效。2024年上半年管理人通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，未超过当年所有基金证券交易佣金总额的30%；2024年下半年通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，未超过当年所有基金证券交易佣金的15%，符合相关规定。

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	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融	400,157.00	33.19%	-	-	-	-	-	-
广发证券	805,404.01	66.81%	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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2023年第4季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-22
2	富荣福康混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网	2024-02-02

	结果暨决议生效的公告	站	
3	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增华西证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-22
4	富荣基金管理有限公司关于董事变更的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-01
5	富荣基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20
6	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
7	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年年度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-30
8	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-04-22
9	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-17
10	富荣基金管理有限公司关于	证券时报、基金管理人网站、	2024-06-18

	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	中国证监会基金电子披露网站	
11	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	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-27
12	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳腾元基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
13	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2024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	2024-07-19
14	富荣基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-24
15	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-30
16	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西证券股份有限公司为销售机构、	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-31

	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		
17	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-08
18	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	2024-08-16
19	富荣基金管理有限公司关于终止北京中植基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-28
20	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2024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	2024-08-31
21	富荣基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金更新招募说明书及产品资料概要的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-09-23
22	关于以通讯方式召开富荣福康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	2024-09-26
23	关于以通讯方式召开富荣福康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	2024-09-27
24	关于以通讯方式召开富荣福	证券时报、基金管理人网站、	2024-09-28

	康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	中国证监会基金电子披露网站	
25	关于富荣福康混合型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-10-17
26	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2024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	2024-10-25
27	富荣福康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	2024-11-05
28	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	2024-11-07
29	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发期货有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024-12-02
30	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	2024-12-03
31	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	2024-12-03

§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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	序 号	持有基金份额比例 达到或者超过20%的 时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机 构	1	20240101 - 20241231	5,256,200.83	2,777,587.24	2,790,000.00	5,243,788.07	59.30%
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高为集中时，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

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§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康混合型证券投资基金设立的文件；
- 13.1.2 《富荣福康混合型证券投资基金基金合同》；
- 13.1.3 《富荣福康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 报告期内富荣福康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
二〇二五年三月三十一日