

富荣量化精选混合型发起式证券投资基金

清算报告

基金管理人：富荣基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

清算报告出具日：2025 年 5 月 19 日

清算报告公告日：2025 年 5 月 23 日

§ 1 重要提示

富荣量化精选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2021]3691 号文《关于准予富荣量化精选混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，自 2022 年 5 月 6 日起《富荣量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）生效。本基金的基金管理人为富荣基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。

根据《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》等法律法规的有关规定及《基金合同》的约定，本基金《基金合同》生效日为 2022 年 5 月 6 日，《基金合同》生效日起三年后的对应日为 2025 年 5 月 6 日。截至 2025 年 5 月 6 日日终，本基金的基金规模低于 2 亿元，触发《基金合同》终止的情形，本基金根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会，即本基金的最后运作日为 2025 年 5 月 6 日，并于 2025 年 5 月 7 日进入清算程序。

根据《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》等法律法规的有关规定及《基金合同》的约定，由本基金的基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成本基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算事宜出具法律意见。

§ 2 基金概况

基金名称	富荣量化精选混合型发起式证券投资基金
基金简称	富荣量化精选混合发起
基金主代码	014556
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 05 月 06 日
报告期末（2025 年 5 月 6 日）基金总份额	10,188,778.66 份
投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极组合管理与风险控制，力争实现达到或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	本基金采用的投资策略有：大类资产配置、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人名称	富荣基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

§ 3 基金运作情况

富荣量化精选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2021]3691 号文《关于准予富荣量化精选混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由富荣基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富荣量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2022 年 5 月 6 日生效，首次设立募集规模为 10,680,402.78 份基金份额。

根据基金管理人于 2025 年 5 月 7 日发布的《关于富荣量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，截至 2025 年 5 月 6 日日终，本基金的基金规模低于 2 亿元，已触发《基金合同》终止的情形，根据《基金合同》约定进入基金财产清算程序并终止基金合同。本基金的最后运作日为 2025 年 5 月 6 日，并于 2025 年 5 月 7 日进入清算程序。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

§ 4 财务会计报告

4.1 最后运作日资产负债表（经审计）

会计主体：富荣量化精选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 5 月 6 日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2025 年 5 月 6 日
资产：	
货币资金	632,672.29
结算备付金	87,111.58
存出保证金	3,256.85

交易性金融资产	5,625,818.00
其中：股票投资	5,625,818.00
买入返售金融资产	—
应收清算款	2,453,612.53
应收利息	—
应收股利	—
应收申购款	—
其他资产	—
资产总计	8,802,471.25
负债和净资产	最后运作日 2025年5月6日
负债：	
应付清算款	—
应付赎回款	54,510.38
应付管理人报酬	10,487.98
应付托管费	1,748.01
应付销售服务费	40.49
应交税费	—
其他负债	2,409.15
负债合计	69,196.01
所有者权益：	
实收基金	10,188,778.66
未分配利润	-1,455,503.42
所有者权益合计	8,733,275.24
负债和所有者权益总计	8,802,471.25

注：1、报告截止日 2025 年 5 月 6 日（基金最后运作日），基金份额总额 10,188,778.66 份。A 类基金份额净值人民币 0.8572 元，基金份额总额 10,118,481.44 份。C 类基金份额净值人民币 0.8466 元，基金份额总额 70,297.22 份。

2、本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了安永华明（2025）专字第 70036562_H26 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 基金财产分配

自最后运作日后至 2025 年 5 月 13 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定，清算费用应由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2 资产处置情况

(1) 本基金最后运作日货币资金为人民币 632,672.29 元，其中托管户存款为人民币 632,353.43 元，应计银行存款利息为人民币 318.86 元。本基金于清算结束日货币资金为人民币 8,748,399.07 元，其中托管户存款为人民币 8,747,542.93 元，应计银行存款利息为人民币 856.14 元。

(2) 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 3,256.85 元，其中上海存出保证金余额为人民币 1,174.91 元，应计上海存出保证金利息人民币 0.47 元，深圳存出保证金余额为人民币 2,080.65 元，应计深圳存出保证金利息人民币 0.82 元。本基金于清算结束日存出保证金余额为人民币 2,515.55 元，其中上海存出保证金余额为人民币 995.04 元，应计上海存出保证金利息人民币 0.54 元，深圳存出保证金余额为人民币 1,519.08 元，应计深圳存出保证金利息人民币 0.89 元。

(3) 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 87,111.58 元，其中上海结算备付金余额为人民币 39,422.96 元，应计上海结算备付金利息人民币 13.87 元，深圳结算备付金余额为人民币 47,657.69 元，应计深圳结算备付金利息人民币 17.06 元。本基金于清算结束日结算备付金余额为人民币 9,905.61 元，其中上海结算备付金余额为人民币 2,685.80 元，应计上海结算备付金利息人民币 16.18 元，深圳结算备付金余额为人民币 7,183.74 元，应计深圳结算备付金利息人民币 19.89 元。

(4) 本基金最后运作日交易性金融资产余额为人民币 5,625,818.00 元，均为股票投资，均于清算期间处置变现，实际变现金额为人民币 5,684,694.77 元，该款项于清算结束日前已划入本基金托管账户。

(5) 本基金最后运作日应收清算款余额为人民币 2,453,612.53 元，于清算期间股票投资交易变现形成的应收清算款为人民币 5,684,694.77 元。上述款项于本次清算结束日前已划入本基金托管账户。

5.3 负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 54,510.38 元，2025 年 5 月 7 日确认最后运作日基金份额持有人申请赎回的应付赎回款为人民币 4,181.42 元。应付赎回款共计人民币 58,691.80 元，已于 2025 年 5 月 7 日至 2025 年 5 月 9 日清算期间支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 10,487.98 元，已于 2025 年 5 月 8 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,748.01 元，已于 2025 年 5 月 8 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 40.49 元，已于 2025 年 5 月 8 日支付。

(5) 本基金最后运作日其他负债为人民币 2,409.15 元，其中，应付交易费用为人民币 2,409.03 元，应付赎回费为人民币 0.12 元，于清算期间确认应付交易费用为人民币 2,650.16 元，确认最后运作日基金份额持有人申请赎回的应付赎回费为人民币 1.76 元。应付交易费用共计人民币 5,059.19 元，已于 2025 年 5 月 8 日支付；应付赎回费共计人民币 1.88 元，已于 2025 年 5 月 7 日至 2025 年 5 月 9 日清算期间支付。

5.4 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2025 年 5 月 7 日至 2025 年 5 月 13 日止清算期间
一、清算收益	
利息收入	542.56
投资收益（损失以“-”填列）	-97,300.39
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	153,527.00
其他收入	10.14
清算收入小计	56,779.31
二、清算费用	
审计费	10,000.00
律师费	15,000.00
其他费用	41.00
清算费用小计	25,041.00
三、清算净损益（净亏损以“-”号填列）	31,738.31

注：（1）利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2025 年 5 月 7 日起至 2025 年 5 月 13 日止清算期间的银行存款利息、存出保证金利息、结算备付金利息。

（2）投资收益系因本基金处置股票资产所产生的投资收益及股息红利补缴税款。

（3）其他收入为 2025 年 5 月 7 日确认投资者赎回申请产生的赎回费收入。

（4）本基金清算期间所产生的审计费、律师费由基金财产承担，已于 2025 年 5 月 12 日支付。

(5) 其他费用为 2025 年 5 月 7 日起至 2025 年 5 月 13 日止清算期间产生的银行汇划费。

5.5 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2025 年 5 月 6 日基金净资产	8,733,275.24
加：清算期间净损益	31,738.31
减：基金净赎回（于 2025 年 5 月 7 日确认的投资者赎回申请）	4,193.32
二、2025 年 5 月 13 日基金净资产	8,760,820.23

根据本基金的基金合同及《关于富荣量化精选混合型发起式证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至 2025 年 5 月 13 日止的剩余财产为人民币 8,760,820.23 元。

自清算期结束日次日（2025 年 5 月 14 日）至清算款划出日前一日的归属于基金份额持有人的银行存款孳生的利息归基金份额持有人所有。因清算款划出日不能确定，暂不能准确预估清算结束日至划出前一日银行存款产生的利息，该期间利息亦属全体基金份额持有人所有，将于划出清算款时一并向基金份额持有人分配。自 2025 年 5 月 14 日至清算款划出日划出清算款产生的汇划费亦由基金份额持有人承担。为保护基金份额持有人利益，支付清算款之日前未结息的应计利息、在途结算备付金及存出保证金将由基金管理人以自有资金在支付清算款之日进行垫付以加快清算速度，实际结息到账金额与垫付金额有差异的由基金管理人承担。

最终支付清算款金额以本基金登记机构的记录为准。基金管理人垫付的资金自资金到账日起至托管户销户为止孳生的利息归基金管理人所有，在托管户销户前向基金管理人支付垫付资金及其孳生的利息。

5.6 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

6.1.1 《富荣量化精选混合型发起式证券投资基金清算审计报告》

6.1.2《上海市通力律师事务所关于<富荣量化精选混合型发起式证券投资基金清算报告>的法律意见》

6.2 存放地点

本基金管理人的住所。

6.3 查阅方式

上述文件可在富荣基金管理有限公司网站上查阅,或者在营业时间内到富荣基金管理有限公司查阅。

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。

客户服务电话: 4006855600

网址: <http://www.furamc.com.cn>

富荣量化精选混合型发起式证券投资基金

基金财产清算小组

2025 年 5 月 23 日