

富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:富荣基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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的真实、准确和完整发表意见	15
§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	18
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	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	71

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	71
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	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	74
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	74
§10 开放式基金份额变动	74
§11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息	79
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	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§13 备查文件目录	80
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	80
13.3 查阅方式	80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	富荣价值精选混合	
基金主代码	006109	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年08月10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	92,175,971.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富荣价值精选混合A	富荣价值精选混合C
下属分级基金的交易代码	006109	006110
报告期末下属分级基金的份额总额	1,004,470.10份	91,171,501.59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	本基金通过灵活应用多种量化策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%
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风险、中预期收益的品种。

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 姓名	任晓伟	石立平

露负责人	联系电话	0755-84356633	010-63639180
	电子邮箱	service@furamc.com.cn	shiliping@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	王江

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	2023年		2022年		2021年	
	富荣价	富荣价值	富荣价值	富荣价值	富荣价值	富荣价值

	值精选混合A	精选混合C	精选混合A	精选混合C	精选混合A	精选混合C
本期已实现收益	-112,220.40	-7,330,252.80	-1,140,425.80	-37,908,628.11	-2,151,094.70	-3,808,390.88
本期利润	-128,954.07	-8,064,852.05	-2,470,224.77	-33,993,736.19	-987,721.19	-6,572,503.30
加权平均基金份额本期利润	-0.1167	-0.0871	-1.4637	-0.3410	-0.0367	-0.0959
本期加权平均净值利润率	-13.13%	-13.06%	-123.58%	-41.25%	-2.53%	-8.68%
本期基金份额净值增长率	-12.36%	-12.63%	-32.18%	-32.44%	-6.48%	-6.76%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	-544,681.52	-51,680,395.87	-506,054.73	-48,592,998.44	2,300,549.14	-10,363,194.39
期末可供分配基金份额利润	-0.5423	-0.5668	-0.4355	-0.4847	0.0647	-0.1042
期末基金资产净值	831,490.78	56,647,802.48	1,097,480.95	71,296,338.51	49,518,122.36	104,712,950.44
期末基金份额净值	0.8278	0.6213	0.9445	0.7111	1.3927	1.0525
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	28.58%	-37.87%	46.70%	-28.89%	116.32%	5.25%

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

富荣价值精选混合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	-2.49%	0.88%	-3.53%	0.43%	1.04%	0.45%
过去六个月	-4.72%	0.91%	-5.25%	0.47%	0.53%	0.44%
过去一年	-12.36%	0.91%	-4.64%	0.46%	-7.72%	0.45%
过去三年	-44.41%	0.94%	-15.39%	0.61%	-29.02%	0.33%
过去五年	63.60%	3.09%	19.86%	0.67%	43.74%	2.42%
自基金合同生效起至今	28.58%	2.99%	13.44%	0.68%	15.14%	2.31%

富荣价值精选混合C

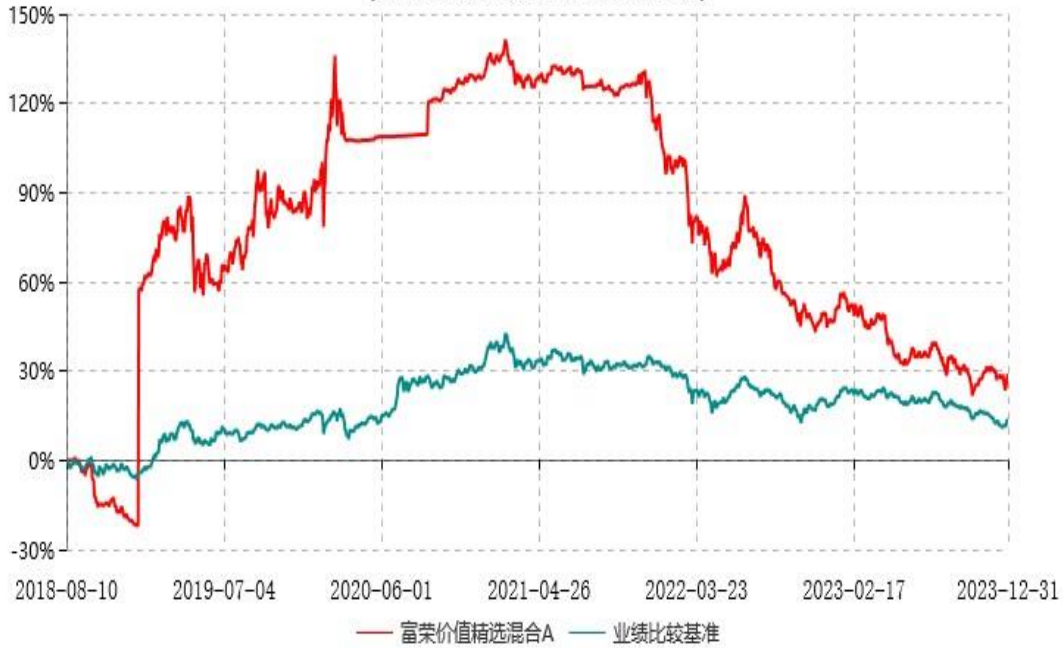
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.57%	0.88%	-3.53%	0.43%	0.96%	0.45%
过去六个月	-4.87%	0.91%	-5.25%	0.47%	0.38%	0.44%
过去一年	-12.63%	0.91%	-4.64%	0.46%	-7.99%	0.45%
过去三年	-44.96%	0.94%	-15.39%	0.61%	-29.57%	0.33%
过去五年	-20.84%	1.14%	19.86%	0.67%	-40.70%	0.47%
自基金合同生效起至今	-37.87%	1.14%	13.44%	0.68%	-51.31%	0.46%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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

富荣价值精选混合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08月10日-2023年12月31日)

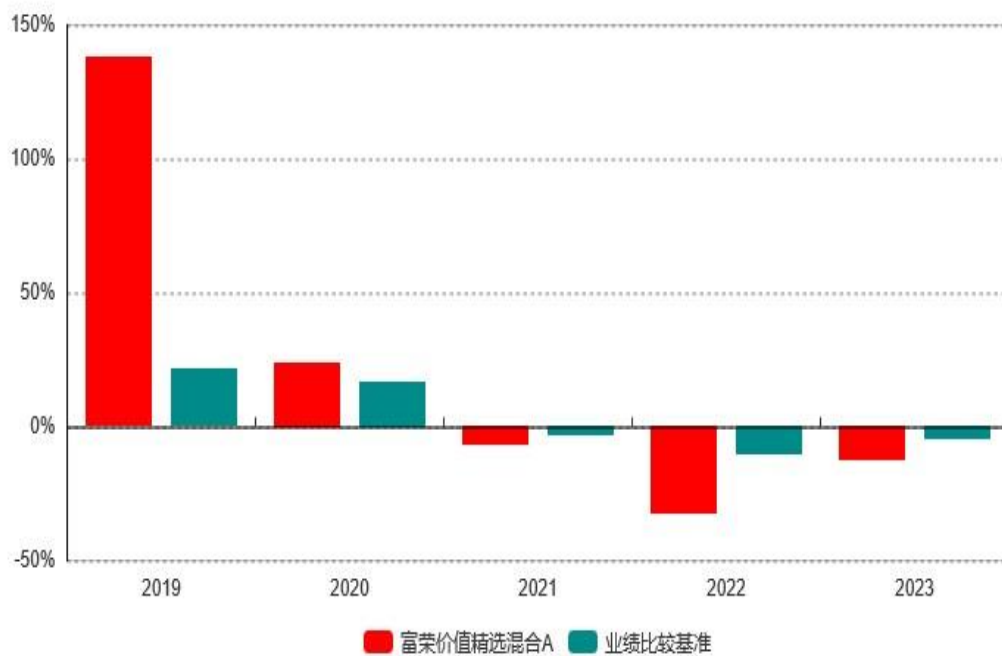


富荣价值精选混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年08月10日-2023年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

截止2023年12月31日止，本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄祥斌	投资一部总经理，基金经理	2021-11-12	2023-07-31	17	武汉大学硕士，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任信达证券研究所资产管理部投资经理、益民服务领先基金基金经理、九泰改革新动力混合基金基金经理、北信瑞丰基金权益投资二部总经理，2021年8月3日加入富荣基金。
李黄海	基金经理	2023-07-31	-	17	博士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任摩根士丹利华鑫数量化投资部投资经理、平安基金量化投资部总监等职务。2020年7月加入富荣基金。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对旗下所有投资组合的同向交易价差情况进行分析，报告期内未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年初，投资者对经济复苏怀有较强的憧憬，而后实际的经济数据不达预期；另一方面，美元迟迟没有降息，美元强势导致国内资金外流。因此，2023年上半年，资本市场热点切换较快，较难把握，我们遵循力争稳健的投资思路，主要布局于经济消费复苏主线，重点投资绩优蓝筹股组合。从报告年度第三季度开始，我们逐渐调整策略，采取全市场均衡配置；到了第四个季度，我们充分发挥灵活的特点，运用量化投资的方法，主要以小盘市值因子为配置风格。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣价值精选混合A基金份额净值为0.8278元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.36%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%；截至报告期末富荣价值精选混合C基金份额净值为0.6213元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-12.63%，同期业绩比较基准收益率为-4.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年度已经结束，年度GDP增长也逐渐明朗，至少有两点与往年不同：其一、出口成为拖累项；其二、我国政府始终坚持“房住不炒”的大政方针，即使在众多房地产企业经营极端困难、甚至知名房企暴雷的情况下，都没有通过大规模投资拉动经济。

反映到中国A股市场，以沪深300指数为例，2023年度是连续第三个下跌的年度，股市的系统性风险在过去三年或得到了充分的释放。

各种类型的A股基金，如果按体量来排序，依次如下：

最大体量的是货币基金，风险较低，预期收益率最低；

第二大规模的是债券型基金，风险较小，但预期收益率也较低；

第三大规模的就是偏股混合型基金，风险高，同时预期收益率也高。

WIND数据显示，从2010年1月4日至2023年12月29日，万得偏股混合型基金指数（885001.WI）滚动三年年化收益率大约是+8.7%，这一水平的收益率可能是维持该类型基金存在的合理收益水平，因为在市场均衡条件下，收益补偿必须与该类型基金所承担的投资风险相匹配。然而，在2023年12月29日，偏股混合型基金过去三年的年化收益率约为-11.2%，即：在过去三年里，市场大多数的偏股混合型基金平均每年亏损-11.2%，而且连续亏了三三年。我们不禁要问：其收益水平不能与风险相匹配，或者股市正在出清？

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;由于A类基金份额不收取销售服务费,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可能有所不同;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2023年12月31日，根据上述分配原则及基金实际运作情况，本报告期未有收益分配事项。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（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《富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2023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（2024）审字第70036562_H12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	富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富荣价值精选灵活配置混合型发起式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，公允反映了富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金，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	<p>富荣价值精选灵活配置混合型发起式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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估富荣价值精选灵活配置混合型发起式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价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序</p>

	<p>以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富荣价值精选灵活配置混合型发起式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价值精选灵活配置混合型发起式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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高鹤、黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
审计报告日期	2024-03-29

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	5,197,055.89	7,144,215.28
结算备付金		732,442.32	880,952.30
存出保证金		29,981.85	99,215.08
交易性金融资产	7.4.7.2	51,995,161.48	64,349,622.89
其中：股票投资		51,995,161.48	64,349,622.89
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	446,000.39
应收股利		-	-
应收申购款		659.50	2,549.88
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		57,955,301.04	72,922,555.82
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022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		-	-
应付赎回款		12,326.42	697.24
应付管理人报酬		29,180.47	37,142.70
应付托管费		4,863.40	6,190.44
应付销售服务费		14,377.42	18,291.92
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	7.4.7.5	415,260.07	466,414.06
负债合计		476,007.78	528,736.36
净资产：			
实收基金	7.4.7.6	92,175,971.69	101,425,693.95
未分配利润	7.4.7.7	-34,696,678.43	-29,031,874.49
净资产合计		57,479,293.26	72,393,819.46
负债和净资产总计		57,955,301.04	72,922,555.82

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额总额92,175,971.69份，其中，下属A类基金份额净值0.8278元，基金份额总额1,004,470.10份；下属C类基金份额净值0.6213元，基金份额总额91,171,501.59份。

7.2 利润表

会计主体：富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
一、营业总收入		-7,390,029.42	-35,323,710.80
1.利息收入		79,841.24	166,569.24

其中：存款利息收入	7.4.7.8	79,841.24	132,289.39
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		-	34,279.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,719,497.12	-38,193,139.26
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-7,608,063.90	-38,970,171.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.10	-	28,999.36
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.11	-	-
股利收益	7.4.7.12	888,566.78	748,033.02
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	-751,332.92	2,585,092.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	959.38	117,766.27
减：二、营业总支出		803,776.70	1,140,250.16
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	377,740.80	508,876.42
2.托管费	7.4.10.2.2	62,956.81	84,812.64
3.销售服务费	7.4.10.2.3	185,915.12	248,022.80
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	7.4.7.15	-	-
7.税金及附加		-	0.07
8.其他费用	7.4.7.16	177,163.97	298,538.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,193,806.12	-36,463,960.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,193,806.12	-36,463,960.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,193,806.12	-36,463,960.96

7.3 净资产变动表

会计主体：富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	101,425,693.95	-29,031,874.49	72,393,819.46
二、本期期初净资产	101,425,693.95	-29,031,874.49	72,393,819.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,249,722.26	-5,664,803.94	-14,914,526.20
（一）、综合收益总额	-	-8,193,806.12	-8,193,806.12
（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）	-9,249,722.26	2,529,002.18	-6,720,720.08

其中：1.基金申购款	1,169,828.98	-315,737.38	854,091.60
2.基金赎回款	-10,419,551.24	2,844,739.56	-7,574,811.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	92,175,971.69	-34,696,678.43	57,479,293.26
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	135,048,293.80	19,182,779.00	154,231,072.80
二、本期期初净资产	135,048,293.80	19,182,779.00	154,231,072.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,622,599.85	-48,214,653.49	-81,837,253.34
（一）、综合收益总额	-	-36,463,960.96	-36,463,960.96
（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）	-33,622,599.85	-11,750,692.53	-45,373,292.38
其中：1.基金申购款	2,233,515.24	-365,948.46	1,867,566.78
2.基金赎回款	-35,856,115.09	-11,384,744.07	-47,240,859.16
（三）、本期向基	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	101,425,693.95	-29,031,874.49	72,393,819.46

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

富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]2431号文《关于准予富荣价值精选灵活配置混合型发起式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8月10日正式生效，首次设立募集规模为20,050,504.95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（以下简称“中国光大银行”）。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、地方政府债、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、衍生品（包括权证、股指期货、股票期权、国债期货等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收

申购款等；权证投资占基金资产净值的0-3%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上可能有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

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

(2) 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

（3）企业所得税

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

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

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

（4）个人所得税

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	5,197,055.89	7,144,215.28
等于：本金	5,195,911.89	7,142,620.81
加：应计利息	1,144.00	1,594.47
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	5,197,055.89	7,144,215.28

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,682,158.63	-	51,995,161.48	313,002.85
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	51,682,158.63	-	51,995,161.48	313,002.85
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	63,285,287.12	-	64,349,622.89	1,064,335.77
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	63,285,287.12	-	64,349,622.89	1,064,335.77

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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6.50	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	276,253.57	326,414.06
其中：交易所市场	276,253.57	326,414.06
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	139,000.00	140,000.00
合计	415,260.07	466,414.06

7.4.7.6 实收基金

7.4.7.6.1 富荣价值精选混合A

金额单位：人民币元

项目 (富荣价值精选混合A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,161,931.83	1,161,931.83
本期申购	207,886.47	207,886.47
本期赎回（以“-”号填列）	-365,348.20	-365,348.20
本期末	1,004,470.10	1,004,470.10

7.4.7.6.2 富荣价值精选混合C

金额单位：人民币元

项目 (富荣价值精选混合C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	100,263,762.12	100,263,762.12
本期申购	961,942.51	961,942.51
本期赎回（以“-”号填列）	-10,054,203.04	-10,054,203.04
本期末	91,171,501.59	91,171,501.59

注：申购包含基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

7.4.7.7 未分配利润

7.4.7.7.1 富荣价值精选混合A

单位：人民币元

项目 (富荣价值精选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-506,054.73	441,603.85	-64,450.88
本期期初	-506,054.73	441,603.85	-64,450.88
本期利润	-112,220.40	-16,733.67	-128,954.07
本期基金份额交易产生的变动数	73,593.61	-53,167.98	20,425.63
其中：基金申购款	-95,002.22	75,414.47	-19,587.75
基金赎回款	168,595.83	-128,582.45	40,013.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-544,681.52	371,702.20	-172,979.32

7.4.7.7.2 富荣价值精选混合C

单位：人民币元

项目 (富荣价值精选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-48,592,998.44	19,625,574.83	-28,967,423.61
本期期初	-48,592,998.44	19,625,574.83	-28,967,423.61
本期利润	-7,330,252.80	-734,599.25	-8,064,852.05
本期基金份额交易产生的变动数	4,242,855.37	-1,734,278.82	2,508,576.55
其中：基金申购款	-470,241.15	174,091.52	-296,149.63
基金赎回款	4,713,096.52	-1,908,370.34	2,804,726.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-51,680,395.87	17,156,696.76	-34,523,699.11

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	67,458.05	107,680.80
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	11,384.39	22,022.69
其他	998.80	2,585.90
合计	79,841.24	132,289.39

注：其他为交易保证金利息收入。

7.4.7.9 股票投资收益

7.4.7.9.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
卖出股票成交总额	465,671,567.68	915,955,494.20
减：卖出股票成本总额	472,150,643.03	952,515,043.36
减：交易费用	1,128,988.55	2,410,622.48
买卖股票差价收入	-7,608,063.90	-38,970,171.64

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	-	24.43
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	28,974.93
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	-	28,999.36

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	-	145,000.00
减：卖出债券(债 转股及债券到期兑	-	116,000.00

付) 成本总额		
减: 应计利息总额	-	24.92
减: 交易费用	-	0.15
买卖债券差价收入	-	28,974.93

7.4.7.11 衍生工具收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无衍生工具产生的投资收益/损失。

7.4.7.12 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	888,566.78	748,033.02
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	888,566.78	748,033.02

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	-751,332.92	2,585,092.95
——股票投资	-751,332.92	2,585,092.95
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-751,332.92	2,585,092.95

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	959.38	117,617.85
基金转换费收入	-	148.42
合计	959.38	117,766.27

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

7.4.7.15 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。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	80,000.00	200,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	963.97	1,338.23
账户维护费	45,000.00	36,000.00
查询费	1,200.00	1,200.00

合计	177,163.97	298,538.23
----	------------	------------

7.4.7.17 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。

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
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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	377,740.80	508,876.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,988.00	5,546.99
应支付基金管理人的净管理费	372,752.80	503,329.43

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

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	62,956.81	84,812.64

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

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣价值精选混合A	富荣价值精选混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	183,301.76	183,301.76
合计	0.00	183,301.76	183,301.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富荣价值精选混合A	富荣价值精选混合C	合计
富荣基金管理有限公司	0.00	245,524.74	245,524.74
合计	0.00	245,524.74	245,524.74

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0.30%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

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

富荣价值精选混合A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

富荣价值精选混合C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	8,395,218.14	8,395,218.14
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	8,395,218.14	-
报告期末持有的基金份额	0.00	8,395,218.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	8.37%

注：1、对于分类基金，比例的分母采用各自类别的总份额。

2、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

3、赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	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	5,197,055.89	67,458.05	7,144,215.28	107,680.80

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，并按银行间同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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

本基金于本期及上年度可比期间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

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/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

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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风险、中预期收益的品种。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、自有资金投资决策委员会、估值委员会等，协助总经理对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。

7.4.13.2 信用风险

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

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

于2023年12月31日，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券。（2022年12月31日：同）

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,197,055.89	-	-	-	5,197,055.89
结算备付金	732,442.32	-	-	-	732,442.32
存出保证金	29,981.85	-	-	-	29,981.85
交易性金融资产	-	-	-	51,995,161.48	51,995,161.48
应收申购款	-	-	-	659.50	659.50
资产总计	5,959,480.06	-	-	51,995,820.98	57,955,301.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,326.42	12,326.42
应付管理人报酬	-	-	-	29,180.47	29,180.47
应付托管费	-	-	-	4,863.40	4,863.40
应付销售服务费	-	-	-	14,377.42	14,377.42
其他负债	-	-	-	415,260.07	415,260.07
负债总计	-	-	-	476,007.78	476,007.78
利率敏感度缺口	5,959,480.06	-	-	不适用	不适用
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	7,144,215.28	-	-	-	7,144,215.28
结算备付金	880,952.30	-	-	-	880,952.30
存出保证金	99,215.08	-	-	-	99,215.08
交易性金融资产	-	-	-	64,349,622.89	64,349,622.89
应收清算款	-	-	-	446,000.39	446,000.39
应收申购款	-	-	-	2,549.88	2,549.88
资产总计	8,124,382.66	-	-	64,798,173.16	72,922,555.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	697.24	697.24
应付管理人报酬	-	-	-	37,142.70	37,142.70
应付托管费	-	-	-	6,190.44	6,190.44
应付销售服务费	-	-	-	18,291.92	18,291.92
其他负债	-	-	-	466,414.06	466,414.06
负债总计	-	-	-	528,736.36	528,736.36
利率敏感度缺口	8,124,382.66	-	-	不适用	不适用

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	51,995,161.48	90.46	64,349,622.89	88.89
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,995,161.48	90.46	64,349,622.89	88.89

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	基金业绩比较基准上升5%	4,523,461.38	5,152,448.33
基金业绩比较基准下降5%	-4,523,461.38	-5,152,448.33	

注：本基金的业绩比较基准=沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	51,995,161.48	64,349,622.89
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	51,995,161.48	64,349,622.89

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，本基金无需要说明的其他重要事项。

(3) 财务报表的批准

本财务报表已于2024年3月29日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	51,995,161.48	89.72
	其中：股票	51,995,161.48	89.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,929,498.21	10.23

8	其他各项资产	30,641.35	0.05
9	合计	57,955,301.04	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	409,114.00	0.71
B	采矿业	412,809.00	0.72
C	制造业	37,572,156.32	65.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	494,672.00	0.86
E	建筑业	2,710,153.00	4.72
F	批发和零售业	1,391,717.00	2.42
G	交通运输、仓储和邮政业	754,319.00	1.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,029,517.16	3.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	767,963.00	1.34
L	租赁和商务服务业	417,594.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	1,922,243.00	3.34
N	水利、环境和公共设施管理业	2,591,259.00	4.51
O	居民服务、修理和其他服务业	132,808.00	0.23
P	教育	257,195.00	0.45
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	131,642.00	0.23
	合计	51,995,161.48	90.46

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	002748	世龙实业	14,600	171,550.00	0.30
2	605178	时空科技	6,100	169,153.00	0.29
3	000890	法尔胜	30,700	166,701.00	0.29
4	002862	实丰文化	7,600	160,512.00	0.28
5	603332	苏州龙杰	13,800	158,148.00	0.28
6	603188	亚邦股份	36,800	155,664.00	0.27
7	001366	播恩集团	9,400	154,818.00	0.27
8	002633	申科股份	13,200	154,308.00	0.27
9	301118	恒光股份	6,300	153,909.00	0.27
10	603021	山东华鹏	23,300	153,547.00	0.27
11	300883	龙利得	20,700	152,145.00	0.26
12	300262	巴安水务	46,600	151,916.00	0.26
13	300387	富邦股份	18,200	151,788.00	0.26
14	301131	聚赛龙	3,000	151,500.00	0.26
15	300849	锦盛新材	11,400	150,936.00	0.26
16	000619	海螺新材	21,800	150,856.00	0.26
17	300405	科隆股份	23,300	150,518.00	0.26
18	600319	亚星化学	26,000	150,280.00	0.26
19	603608	天创时尚	26,700	149,787.00	0.26
20	600421	华嵘控股	13,400	149,142.00	0.26
21	603137	恒尚节能	7,600	149,112.00	0.26
22	688517	金冠电气	9,400	148,426.00	0.26
23	003017	大洋生物	6,100	148,352.00	0.26
24	603329	上海雅仕	9,300	148,242.00	0.26
25	300069	金利华电	9,200	148,120.00	0.26
26	300716	泉为科技	12,800	148,096.00	0.26
27	300808	久量股份	9,500	148,010.00	0.26

28	301040	中环海陆	7,800	147,966.00	0.26
29	002513	蓝丰生化	21,300	147,396.00	0.26
30	002114	罗平锌电	19,700	147,356.00	0.26
31	000668	荣丰控股	11,600	147,320.00	0.26
32	301003	江苏博云	5,900	147,264.00	0.26
33	300929	华骐环保	12,100	147,257.00	0.26
34	603389	亚振家居	22,200	147,186.00	0.26
35	300956	英力股份	7,900	147,177.00	0.26
36	300321	同大股份	7,600	147,060.00	0.26
37	002856	美芝股份	9,800	147,000.00	0.26
38	688659	元琛科技	11,800	146,910.00	0.26
39	301032	新柴股份	14,500	146,885.00	0.26
40	300626	华瑞股份	13,500	146,475.00	0.25
41	000856	冀东装备	15,300	146,421.00	0.25
42	002205	国统股份	13,500	146,205.00	0.25
43	300594	朗进科技	7,000	146,160.00	0.25
44	300886	华业香料	5,900	146,143.00	0.25
45	003027	同兴环保	8,000	146,080.00	0.25
46	300865	大宏立	6,500	145,925.00	0.25
47	301068	大地海洋	4,800	145,920.00	0.25
48	300449	汉邦高科	21,700	145,824.00	0.25
49	002809	红墙股份	13,400	145,792.00	0.25
50	688090	瑞松科技	4,500	145,755.00	0.25
51	603079	圣达生物	10,000	145,700.00	0.25
52	301125	腾亚精工	7,700	145,684.00	0.25
53	002842	翔鹭钨业	16,700	145,624.00	0.25
54	600243	青海华鼎	30,500	145,485.00	0.25
55	301024	霍普股份	4,800	145,440.00	0.25
56	002295	精艺股份	17,800	145,426.00	0.25
57	603041	美思德	10,800	145,368.00	0.25
58	300478	杭州高新	11,500	145,360.00	0.25

59	002871	伟隆股份	13,000	145,340.00	0.25
60	300117	嘉寓股份	50,100	145,290.00	0.25
61	603045	福达合金	9,200	145,268.00	0.25
62	301098	金埔园林	12,300	145,263.00	0.25
63	301023	江南奕帆	3,500	145,250.00	0.25
63	300644	南京聚隆	7,000	145,250.00	0.25
65	301113	雅艺科技	4,500	145,215.00	0.25
66	002211	宏达新材	36,300	145,200.00	0.25
66	002209	达意隆	13,200	145,200.00	0.25
68	301002	崧盛股份	7,000	145,180.00	0.25
69	603828	柯利达	38,000	145,160.00	0.25
70	603221	爱丽家居	14,600	145,124.00	0.25
71	300022	吉峰科技	29,400	144,942.00	0.25
72	301008	宏昌科技	4,800	144,912.00	0.25
73	301053	远信工业	5,200	144,872.00	0.25
74	300670	大烨智能	18,500	144,855.00	0.25
75	002058	威尔泰	10,400	144,768.00	0.25
76	688528	秦川物联	13,100	144,755.00	0.25
77	300923	研奥股份	5,900	144,668.00	0.25
78	300995	奇德新材	6,800	144,636.00	0.25
79	300749	顶固集创	15,600	144,612.00	0.25
80	603717	天域生态	18,800	144,572.00	0.25
81	603172	万丰股份	8,200	144,566.00	0.25
82	301107	瑜欣电子	4,500	144,405.00	0.25
83	003011	海象新材	6,800	144,364.00	0.25
84	300907	康平科技	6,500	144,235.00	0.25
85	000702	正虹科技	23,000	144,210.00	0.25
86	002620	瑞和股份	26,800	144,184.00	0.25
87	300960	通业科技	6,500	144,170.00	0.25
88	300906	日月明	5,700	144,153.00	0.25
89	300823	建科机械	6,700	144,117.00	0.25

90	603709	中源家居	8,000	144,000.00	0.25
91	688501	青达环保	8,600	143,878.00	0.25
92	002105	信隆健康	22,200	143,856.00	0.25
93	001231	农心科技	6,900	143,727.00	0.25
94	300126	锐奇股份	20,100	143,715.00	0.25
95	301359	东南电子	5,400	143,694.00	0.25
96	688681	科汇股份	9,300	143,685.00	0.25
97	300243	瑞丰高材	14,700	143,619.00	0.25
98	300163	先锋新材	37,400	143,616.00	0.25
99	605033	美邦股份	8,000	143,600.00	0.25
100	301161	唯万密封	7,100	143,562.00	0.25
101	300665	飞鹿股份	16,600	143,424.00	0.25
102	300901	中胤时尚	14,000	143,360.00	0.25
103	688616	西力科技	10,500	143,220.00	0.25
104	300640	德艺文创	22,300	143,166.00	0.25
105	300610	晨化股份	12,700	143,129.00	0.25
106	300515	三德科技	12,400	143,096.00	0.25
107	300816	艾可蓝	5,800	143,086.00	0.25
108	301429	森泰股份	7,000	143,080.00	0.25
109	605180	华生科技	10,200	142,800.00	0.25
110	003001	中岩大地	7,900	142,753.00	0.25
111	002778	中晟高科	9,500	142,690.00	0.25
112	300876	蒙泰高新	5,700	142,614.00	0.25
113	002963	豪尔赛	9,200	142,600.00	0.25
114	001211	双枪科技	5,900	142,544.00	0.25
115	003003	天元股份	12,400	142,476.00	0.25
116	300992	泰福泵业	6,600	142,428.00	0.25
117	002921	联诚精密	8,700	142,419.00	0.25
118	301300	远翔新材	4,500	142,335.00	0.25
119	300838	浙江力诺	8,700	142,332.00	0.25
120	301209	联合化学	5,700	142,272.00	0.25

120	002247	聚力文化	60,800	142,272.00	0.25
122	600193	创兴资源	27,500	142,175.00	0.25
123	605255	天普股份	8,100	142,155.00	0.25
124	300836	佰奥智能	5,000	142,100.00	0.25
125	688655	迅捷兴	9,400	141,940.00	0.25
126	300971	博亚精工	5,700	141,930.00	0.25
127	002857	三晖电气	8,600	141,900.00	0.25
128	301079	邵阳液压	8,200	141,860.00	0.25
129	300535	达威股份	8,100	141,831.00	0.25
130	300417	南华仪器	11,300	141,815.00	0.25
131	300931	通用电梯	16,800	141,792.00	0.25
132	002836	新宏泽	16,200	141,750.00	0.25
133	603268	松发股份	8,200	141,696.00	0.25
134	603238	诺邦股份	10,300	141,625.00	0.25
135	605081	太和水	10,200	141,576.00	0.25
136	300819	聚杰微纤	9,100	141,505.00	0.25
137	688092	爱科科技	4,600	141,496.00	0.25
138	300658	延江股份	20,900	141,493.00	0.25
139	603958	哈森股份	15,600	141,492.00	0.25
140	688096	京源环保	15,100	141,487.00	0.25
141	002278	神开股份	24,100	141,467.00	0.25
142	002830	名雕股份	9,500	141,455.00	0.25
143	301156	美农生物	7,500	141,450.00	0.25
144	002629	仁智股份	35,900	141,446.00	0.25
145	301027	华蓝集团	11,300	141,363.00	0.25
146	300611	美力科技	12,300	141,327.00	0.25
147	301055	张小泉	9,800	141,316.00	0.25
148	002719	麦趣尔	12,200	141,276.00	0.25
149	600356	恒丰纸业	17,700	141,246.00	0.25
150	300947	德必集团	9,000	141,210.00	0.25
151	002715	登云股份	8,700	141,201.00	0.25

152	603090	宏盛股份	6,000	141,120.00	0.25
152	000929	兰州黄河	14,400	141,120.00	0.25
154	600883	博闻科技	16,600	141,100.00	0.25
155	603159	上海亚虹	8,600	141,040.00	0.25
156	688178	万德斯	7,800	141,024.00	0.25
156	600202	哈空调	22,600	141,024.00	0.25
158	300329	海伦钢琴	18,900	140,805.00	0.24
159	301043	绿岛风	4,300	140,739.00	0.24
160	001336	楚环科技	4,900	140,728.00	0.24
161	301273	瑞晨环保	5,100	140,709.00	0.24
162	600165	宁科生物	41,600	140,608.00	0.24
163	002144	宏达高科	12,100	140,602.00	0.24
164	000622	恒立实业	32,100	140,598.00	0.24
165	001202	炬申股份	8,000	140,560.00	0.24
166	688669	聚石化学	7,500	140,550.00	0.24
167	000695	滨海能源	13,000	140,530.00	0.24
168	300703	创源股份	12,500	140,500.00	0.24
169	603073	彩蝶实业	7,000	140,490.00	0.24
170	300385	雪浪环境	20,900	140,448.00	0.24
171	301167	建研设计	8,300	140,436.00	0.24
172	603810	丰山集团	10,500	140,385.00	0.24
173	002789	建艺集团	10,200	140,352.00	0.24
174	300950	德固特	8,700	140,331.00	0.24
175	300076	GQY视讯	25,700	140,322.00	0.24
176	605303	园林股份	11,500	140,300.00	0.24
177	301182	凯旺科技	6,000	140,280.00	0.24
178	688565	力源科技	16,600	140,270.00	0.24
179	300743	天地数码	10,100	140,188.00	0.24
180	300621	维业股份	12,200	140,178.00	0.24
181	301010	晶雪节能	7,500	140,175.00	0.24
182	002188	中天服务	21,300	140,154.00	0.24

183	600778	友好集团	22,400	140,000.00	0.24
184	300564	筑博设计	10,400	139,984.00	0.24
185	300152	新动力	47,900	139,868.00	0.24
186	301081	严牌股份	12,600	139,860.00	0.24
187	300970	华绿生物	8,100	139,806.00	0.24
188	002802	洪汇新材	10,900	139,629.00	0.24
189	300854	中兰环保	8,000	139,600.00	0.24
190	003008	开普检测	5,000	139,550.00	0.24
191	301057	汇隆新材	8,300	139,440.00	0.24
192	688081	兴图新科	8,100	139,401.00	0.24
193	300717	华信新材	8,300	139,357.00	0.24
194	002820	桂发祥	12,200	139,324.00	0.24
195	688355	明志科技	7,000	139,300.00	0.24
196	300955	嘉亨家化	6,300	139,293.00	0.24
197	301105	鸿铭股份	3,700	139,231.00	0.24
198	603616	韩建河山	24,900	139,191.00	0.24
199	688069	德林海	7,000	139,160.00	0.24
200	605287	德才股份	8,200	139,154.00	0.24
201	300013	新宁物流	36,800	139,104.00	0.24
202	000605	渤海股份	21,700	139,097.00	0.24
203	688218	江苏北人	7,000	139,090.00	0.24
204	002652	扬子新材	43,600	139,084.00	0.24
205	603822	嘉澳环保	5,000	139,050.00	0.24
206	002696	百洋股份	21,000	139,020.00	0.24
207	603838	四通股份	19,300	138,960.00	0.24
207	301049	超越科技	6,000	138,960.00	0.24
209	002910	庄园牧场	12,700	138,938.00	0.24
210	002357	富临运业	18,400	138,920.00	0.24
211	002207	准油股份	19,900	138,902.00	0.24
212	300804	广康生化	4,500	138,870.00	0.24
213	001259	利仁科技	4,900	138,768.00	0.24

214	603269	海鸥股份	10,300	138,741.00	0.24
215	300810	中科海讯	6,800	138,720.00	0.24
216	603183	建研院	29,700	138,699.00	0.24
217	300746	汉嘉设计	13,800	138,690.00	0.24
218	300899	上海凯鑫	5,100	138,618.00	0.24
219	688607	康众医疗	6,800	138,584.00	0.24
220	688679	通源环境	10,800	138,564.00	0.24
221	301288	清研环境	7,300	138,554.00	0.24
222	300334	津膜科技	17,900	138,546.00	0.24
223	300521	爱司凯	10,000	138,500.00	0.24
224	300877	金春股份	8,000	138,480.00	0.24
225	688701	卓锦股份	15,300	138,465.00	0.24
226	002231	奥维通信	21,200	138,436.00	0.24
227	600493	凤竹纺织	20,600	138,432.00	0.24
227	000638	万方发展	20,600	138,432.00	0.24
229	300103	达刚控股	21,800	138,430.00	0.24
230	301198	喜悦智行	11,400	138,396.00	0.24
231	688379	华光新材	7,000	138,390.00	0.24
232	688638	誉辰智能	2,300	138,368.00	0.24
233	600448	华纺股份	41,900	138,270.00	0.24
234	301163	宏德股份	5,100	138,210.00	0.24
235	688067	爱威科技	5,800	138,098.00	0.24
236	300675	建科院	9,100	137,865.00	0.24
237	003023	彩虹集团	6,800	137,768.00	0.24
238	301192	泰祥股份	6,000	137,760.00	0.24
239	300371	汇中股份	11,300	137,747.00	0.24
240	688309	恒誉环保	6,900	137,724.00	0.24
241	301233	盛帮股份	3,100	137,702.00	0.24
242	688021	奥福环保	6,600	137,610.00	0.24
243	603716	塞力医疗	12,400	137,516.00	0.24
244	605069	正和生态	14,000	137,480.00	0.24

245	301036	双乐股份	6,200	137,454.00	0.24
246	300871	回盛生物	9,500	137,370.00	0.24
247	688129	东来技术	8,300	137,365.00	0.24
247	002899	英派斯	8,300	137,365.00	0.24
249	300753	爱朋医疗	8,000	137,360.00	0.24
250	688455	科捷智能	10,800	137,268.00	0.24
251	000573	粤宏远 A	40,600	137,228.00	0.24
252	688011	新光光电	5,800	137,170.00	0.24
253	301197	工大科雅	7,300	137,167.00	0.24
254	300635	中达安	10,900	137,122.00	0.24
255	600107	美尔雅	22,400	137,088.00	0.24
256	300984	金沃股份	4,900	137,004.00	0.24
257	600235	民丰特纸	22,300	136,922.00	0.24
257	002072	凯瑞德	22,300	136,922.00	0.24
259	300912	凯龙高科	7,600	136,876.00	0.24
260	300897	山科智能	4,000	136,800.00	0.24
261	603272	联翔股份	8,100	136,728.00	0.24
262	301065	本立科技	6,000	136,500.00	0.24
263	301022	海泰科	5,000	136,400.00	0.24
264	002861	瀛通通讯	9,200	136,344.00	0.24
264	002494	华斯股份	24,700	136,344.00	0.24
266	002883	中设股份	11,100	136,308.00	0.24
267	600082	海泰发展	39,500	136,275.00	0.24
268	600539	狮头股份	19,000	136,230.00	0.24
269	603316	诚邦股份	20,200	136,148.00	0.24
270	001209	洪兴股份	7,600	136,116.00	0.24
271	301295	美硕科技	4,100	136,079.00	0.24
272	688163	赛伦生物	6,800	135,932.00	0.24
273	301336	趣睡科技	3,100	135,749.00	0.24
274	300649	杭州园林	8,100	135,675.00	0.24
275	688395	正弦电气	5,900	135,641.00	0.24

276	300689	澄天伟业	7,000	135,590.00	0.24
277	300948	冠中生态	9,400	135,454.00	0.24
278	603059	倍加洁	6,000	135,360.00	0.24
279	603655	朗博科技	6,500	135,330.00	0.24
280	002826	易明医药	11,400	135,318.00	0.24
281	600156	华升股份	27,500	135,300.00	0.24
282	000590	启迪药业	15,100	135,296.00	0.24
283	688109	品茗科技	4,800	135,216.00	0.24
284	300270	中威电子	17,500	135,100.00	0.24
285	000608	阳光股份	46,900	135,072.00	0.23
286	002848	高斯贝尔	11,500	135,010.00	0.23
287	600444	国机通用	9,000	135,000.00	0.23
288	605318	法狮龙	8,400	134,988.00	0.23
289	003041	真爱美家	8,100	134,865.00	0.23
290	600137	浪莎股份	7,400	134,828.00	0.23
291	300935	盈建科	4,900	134,309.00	0.23
292	301228	实朴检测	8,100	134,298.00	0.23
293	603214	爱婴室	8,200	134,152.00	0.23
294	002199	东晶电子	14,300	134,134.00	0.23
295	688056	莱伯泰科	4,000	134,040.00	0.23
296	301130	西点药业	4,800	133,824.00	0.23
297	002193	如意集团	20,200	133,724.00	0.23
298	002760	凤形股份	6,100	133,712.00	0.23
299	000953	河化股份	24,400	133,468.00	0.23
300	688335	复洁环保	10,400	133,432.00	0.23
301	300462	华铭智能	11,300	133,227.00	0.23
302	300736	百邦科技	10,400	132,808.00	0.23
303	688171	纬德信息	5,900	132,750.00	0.23
304	002828	贝肯能源	12,700	132,461.00	0.23
305	600697	欧亚集团	10,400	132,392.00	0.23
306	688217	睿昂基因	3,700	132,386.00	0.23

307	001210	金房能源	6,700	132,325.00	0.23
308	688420	美腾科技	5,100	131,784.00	0.23
309	688115	思林杰	3,800	131,746.00	0.23
310	600455	博通股份	5,300	131,705.00	0.23
311	600232	金鹰股份	21,700	131,502.00	0.23
312	600692	亚通股份	21,100	131,453.00	0.23
313	603139	康惠制药	7,000	131,390.00	0.23
314	600889	南京化纤	22,800	131,328.00	0.23
315	000632	三木集团	28,700	131,159.00	0.23
316	300844	山水比德	3,800	131,138.00	0.23
317	600561	江西长运	20,400	130,968.00	0.23
318	688193	仁度生物	2,900	130,848.00	0.23
319	301075	多瑞医药	4,900	130,683.00	0.23
320	300106	西部牧业	13,600	130,288.00	0.23
321	300845	捷安高科	7,200	130,104.00	0.23
321	002780	三夫户外	10,400	130,104.00	0.23
323	000679	大连友谊	23,500	129,720.00	0.23
324	000004	国华网安	8,000	129,040.00	0.22
325	301234	五洲医疗	3,800	128,744.00	0.22
326	603161	科华控股	8,000	127,840.00	0.22
327	301001	凯淳股份	5,000	127,700.00	0.22
328	688329	艾隆科技	5,100	126,786.00	0.22
329	301178	天亿马	3,900	126,477.00	0.22
330	300338	开元教育	28,200	125,490.00	0.22
331	688229	博睿数据	2,600	124,982.00	0.22
332	300807	天迈科技	3,900	122,772.00	0.21
333	603860	中公高科	3,800	117,990.00	0.21
334	688004	博汇科技	4,000	117,480.00	0.20
335	603789	星光农机	9,300	99,789.00	0.17
336	603829	洛凯股份	5,300	86,549.00	0.15
337	688611	杭州柯林	2,600	85,228.00	0.15

338	600615	丰华股份	6,900	83,559.00	0.15
339	600149	廊坊发展	14,800	83,324.00	0.14
340	600791	京能置业	17,000	82,620.00	0.14
341	000571	新大洲A	27,700	81,992.00	0.14
342	002591	恒大高新	11,500	81,765.00	0.14
343	603725	天安新材	7,300	81,249.00	0.14
344	300637	扬帆新材	7,700	80,157.00	0.14
345	600969	郴电国际	12,300	79,950.00	0.14
346	600802	福建水泥	15,300	79,254.00	0.14
347	600099	林海股份	7,600	77,672.00	0.14
348	300254	仟源医药	8,000	77,040.00	0.13
349	002377	国创高新	30,300	76,659.00	0.13
350	600148	长春一东	4,600	75,900.00	0.13
351	000985	大庆华科	4,600	74,428.00	0.13
352	600234	科新发展	7,900	68,414.00	0.12
353	603226	菲林格尔	9,400	65,424.00	0.11
354	002890	弘宇股份	4,200	64,890.00	0.11
355	603356	华菱精工	4,400	64,372.00	0.11
356	603657	春光科技	4,000	64,360.00	0.11
357	001226	拓山重工	1,800	64,044.00	0.11
358	603150	万朗磁塑	2,200	63,910.00	0.11
359	605258	协和电子	2,300	63,871.00	0.11
360	600768	宁波富邦	5,300	62,805.00	0.11
361	603580	艾艾精工	4,200	62,538.00	0.11
362	688251	井松智能	2,146	62,405.68	0.11
363	603320	迪贝电气	3,900	62,049.00	0.11
364	600847	万里股份	5,200	61,984.00	0.11
365	688597	煜邦电力	6,800	61,880.00	0.11
366	301037	保立佳	3,100	61,783.00	0.11
367	300169	天晟新材	8,600	61,748.00	0.11
368	301226	祥明智能	2,700	61,641.00	0.11

369	002136	安纳达	5,300	61,586.00	0.11
370	301006	迈拓股份	3,400	61,574.00	0.11
371	300509	新美星	8,500	61,455.00	0.11
372	603499	翔港科技	5,700	61,332.00	0.11
373	002718	友邦吊顶	3,600	61,236.00	0.11
374	300721	怡达股份	4,100	61,213.00	0.11
375	688215	瑞晟智能	1,700	61,115.00	0.11
376	300920	润阳科技	2,900	61,045.00	0.11
377	301388	欣灵电气	2,500	60,975.00	0.11
378	301237	和顺科技	2,000	60,940.00	0.11
379	300789	唐源电气	2,700	60,858.00	0.11
380	000691	亚太实业	12,000	60,840.00	0.11
381	300991	创益通	3,500	60,830.00	0.11
382	603022	新通联	5,900	60,770.00	0.11
383	688367	工大高科	3,400	60,656.00	0.11
384	002853	皮阿诺	4,700	60,583.00	0.11
385	603182	嘉华股份	4,100	60,557.00	0.11
386	301066	万事利	4,700	60,536.00	0.11
387	605155	西大门	3,900	60,372.00	0.11
388	688026	洁特生物	3,500	60,340.00	0.10
389	603955	大千生态	4,100	60,229.00	0.10
390	603080	新疆火炬	3,600	59,976.00	0.10
391	300930	屹通新材	2,500	59,800.00	0.10
392	603679	华体科技	4,000	59,720.00	0.10
393	688350	富淼科技	3,600	59,508.00	0.10
394	603900	莱绅通灵	8,900	59,452.00	0.10
395	603637	镇海股份	6,600	59,400.00	0.10
396	605298	必得科技	3,800	59,242.00	0.10
397	605003	众望布艺	3,000	59,220.00	0.10
398	688038	中科通达	4,100	59,081.00	0.10
399	688013	天臣医疗	2,800	59,080.00	0.10

400	688656	浩欧博	1,689	58,709.64	0.10
401	688466	金科环境	3,300	58,575.00	0.10
402	600051	宁波联合	8,100	58,482.00	0.10
403	688296	和达科技	3,228	58,007.16	0.10
404	301287	康力源	1,600	57,664.00	0.10
405	603506	南都物业	5,300	57,611.00	0.10
406	600857	宁波中百	6,100	57,523.00	0.10
407	688393	安必平	2,300	57,431.00	0.10
408	301314	科瑞思	1,300	56,732.00	0.10
409	603813	原尚股份	3,500	56,525.00	0.10
410	600793	宜宾纸业	4,700	54,614.00	0.10
411	000609	中迪投资	7,500	49,650.00	0.09
412	002767	先锋电子	200	3,216.00	0.01
413	002691	冀凯股份	400	2,996.00	0.01
414	300281	金明精机	500	2,995.00	0.01
415	300927	江天化学	100	1,685.00	0.00

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	688111	金山办公	8,519,804.34	11.77
2	601318	中国平安	7,460,857.00	10.31
3	600941	中国移动	6,553,188.00	9.05
4	000568	泸州老窖	6,297,956.00	8.70
5	300059	东方财富	6,094,104.20	8.42
6	000858	五粮液	6,031,772.00	8.33
7	600519	贵州茅台	5,359,533.00	7.40
8	600036	招商银行	5,238,160.00	7.24

9	601888	中国中免	4,696,172.00	6.49
10	600585	海螺水泥	4,412,338.00	6.09
11	000063	中兴通讯	4,041,807.00	5.58
12	600276	恒瑞医药	3,977,111.40	5.49
13	600887	伊利股份	3,901,696.00	5.39
14	601728	中国电信	3,896,396.00	5.38
15	601857	中国石油	3,779,878.00	5.22
16	000538	云南白药	3,634,746.80	5.02
17	603986	兆易创新	3,467,501.00	4.79
18	002415	海康威视	3,435,038.00	4.74
19	603501	韦尔股份	3,332,036.00	4.60
20	002756	永兴材料	3,283,999.40	4.54
21	601088	中国神华	3,278,994.00	4.53
22	603259	药明康德	3,213,568.00	4.44
23	600050	中国联通	3,022,906.00	4.18
24	000977	浪潮信息	3,009,517.00	4.16
25	600309	万华化学	2,957,239.60	4.08
26	000338	潍柴动力	2,915,823.36	4.03
27	002027	分众传媒	2,845,253.00	3.93
28	600779	水井坊	2,754,602.04	3.81
29	300036	超图软件	2,434,475.00	3.36
30	000066	中国长城	2,414,825.00	3.34
31	600809	山西汾酒	2,308,291.00	3.19
32	002594	比亚迪	2,253,589.00	3.11
33	002373	千方科技	2,234,830.77	3.09
34	601012	隆基绿能	2,216,417.86	3.06
35	000002	万科 A	2,194,459.00	3.03
36	600188	兖矿能源	2,189,092.00	3.02
37	601800	中国交建	2,129,435.00	2.94
38	601360	三六零	2,126,948.00	2.94
39	688711	宏微科技	2,061,754.22	2.85

40	002466	天齐锂业	2,016,738.00	2.79
41	300842	帝科股份	1,973,063.52	2.73
42	688002	睿创微纳	1,954,165.61	2.70
43	002304	洋河股份	1,937,593.00	2.68
44	002938	鹏鼎控股	1,914,332.00	2.64
45	600867	通化东宝	1,872,310.00	2.59
46	000997	新大陆	1,852,391.00	2.56
47	601669	中国电建	1,838,354.00	2.54
48	601628	中国人寿	1,802,281.00	2.49
49	301236	软通动力	1,754,718.00	2.42
50	601100	恒立液压	1,724,566.00	2.38
51	688080	映翰通	1,715,943.76	2.37
52	002142	宁波银行	1,698,802.00	2.35
53	002389	航天彩虹	1,643,287.00	2.27
54	600487	亨通光电	1,582,582.60	2.19
55	002555	三七互娱	1,581,008.00	2.18
56	601225	陕西煤业	1,580,982.00	2.18
57	688047	龙芯中科	1,580,040.53	2.18
58	300661	圣邦股份	1,486,703.00	2.05
59	688008	澜起科技	1,483,331.00	2.05
60	002179	中航光电	1,482,998.66	2.05
61	600048	保利发展	1,480,212.00	2.04
62	605123	派克新材	1,450,238.00	2.00

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	600519	贵州茅台	10,975,121.00	15.16

2	601318	中国平安	10,686,885.80	14.76
3	000858	五粮液	10,274,878.00	14.19
4	688111	金山办公	9,735,909.06	13.45
5	600887	伊利股份	7,353,297.63	10.16
6	300059	东方财富	7,325,240.40	10.12
7	600036	招商银行	7,236,284.00	10.00
8	600941	中国移动	7,093,755.91	9.80
9	600585	海螺水泥	6,862,966.00	9.48
10	000568	泸州老窖	6,289,310.00	8.69
11	000538	云南白药	5,875,102.88	8.12
12	601888	中国中免	5,483,688.39	7.57
13	600309	万华化学	5,033,768.80	6.95
14	002415	海康威视	4,950,064.00	6.84
15	000338	潍柴动力	4,808,379.00	6.64
16	002027	分众传媒	4,475,215.00	6.18
17	000002	万科A	4,275,088.00	5.91
18	000063	中兴通讯	4,268,858.23	5.90
19	600690	海尔智家	4,217,618.00	5.83
20	601857	中国石油	4,044,051.00	5.59
21	600809	山西汾酒	3,905,662.00	5.40
22	600276	恒瑞医药	3,752,489.00	5.18
23	603986	兆易创新	3,642,937.00	5.03
24	601728	中国电信	3,582,366.00	4.95
25	002756	永兴材料	3,452,316.77	4.77
26	603501	韦尔股份	3,332,657.30	4.60
27	601088	中国神华	3,262,088.00	4.51
28	000001	平安银行	3,136,649.00	4.33
29	600436	片仔癀	3,045,690.00	4.21
30	000977	浪潮信息	3,040,011.00	4.20
31	600048	保利发展	2,962,837.82	4.09
32	000333	美的集团	2,893,427.00	4.00

33	002142	宁波银行	2,828,958.50	3.91
34	603259	药明康德	2,797,170.00	3.86
35	601636	旗滨集团	2,564,153.12	3.54
36	600050	中国联通	2,497,578.00	3.45
37	000895	双汇发展	2,470,888.82	3.41
38	601012	隆基绿能	2,407,393.64	3.33
39	600056	中国医药	2,307,332.94	3.19
40	600009	上海机场	2,268,348.00	3.13
41	600779	水井坊	2,223,144.00	3.07
42	300036	超图软件	2,191,174.00	3.03
43	000066	中国长城	2,138,238.00	2.95
44	300842	帝科股份	2,102,279.10	2.90
45	600188	兖矿能源	2,099,547.00	2.90
46	002594	比亚迪	2,041,120.00	2.82
47	002373	千方科技	2,004,167.00	2.77
48	300015	爱尔眼科	1,997,179.20	2.76
49	601360	三六零	1,991,245.00	2.75
50	600867	通化东宝	1,987,845.00	2.75
51	601800	中国交建	1,985,646.00	2.74
52	002466	天齐锂业	1,961,276.00	2.71
53	601668	中国建筑	1,946,585.00	2.69
54	688002	睿创微纳	1,928,487.91	2.66
55	600754	锦江酒店	1,907,821.00	2.64
56	002304	洋河股份	1,890,610.00	2.61
57	688711	宏微科技	1,865,253.84	2.58
58	601166	兴业银行	1,824,602.00	2.52
59	000997	新大陆	1,724,743.00	2.38
60	002555	三七互娱	1,702,998.00	2.35
61	601100	恒立液压	1,699,715.01	2.35
62	601628	中国人寿	1,684,054.00	2.33
63	601669	中国电建	1,635,500.00	2.26

64	301236	软通动力	1,630,272.00	2.25
65	688080	映翰通	1,624,540.55	2.24
66	002938	鹏鼎控股	1,586,367.00	2.19
67	601225	陕西煤业	1,559,009.00	2.15
68	601111	中国国航	1,549,000.00	2.14
69	688047	龙芯中科	1,546,812.25	2.14
70	002179	中航光电	1,507,739.64	2.08
71	002389	航天彩虹	1,489,198.00	2.06

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	460,547,514.54
卖出股票收入（成交）总额	465,671,567.68

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，世龙实业在报告编制日前一年内因定期报告披露违规、未依法履行职责及特定重大事项披露违规被深圳证券交易所及中国证券监督管理委员会出具监管关注函及立案调查。时空科技在报告编制日前一年内因未依法履行职责及信息披露不准确被上海证券交易所及中国证券监督管理委员会出具警示函。申科股份在报告编制日前一年内因未依法履行其他职责分别被深圳证券交易所及中国证券监督管理委员会江苏监管局出具监管函及警示函。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	29,981.85
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	659.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,641.35

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未存在流通受限情况。

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
富荣价值精选混合A	303	3,315.08	47,713.32	4.7501%	956,756.78	95.2499%
富荣价值精选混合C	656	138,980.95	90,260,701.90	99.001%	910,799.69	0.999%
合计	922	99,973.94	90,308,415.22	97.9739%	1,867,556.47	2.0261%

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	富荣价值精选混合A	126.24	0.01%
	富荣价值精选混合C	-	-
	合计	126.24	0.00%

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	富荣价值精选混合A	0
	富荣价值精选混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	富荣价值精选混合A	0
	富荣价值精选混合C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金本报告期末无发起资金、基金管理人高级管理人员等持有份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	富荣价值精选混合A	富荣价值精选混合C
基金合同生效日(2018年08月10日)基金份额总额	49,504.95	20,001,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,161,931.83	100,263,762.12
本报告期基金总申购份额	207,886.47	961,942.51
减：本报告期基金总赎回份额	365,348.20	10,054,203.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,004,470.10	91,171,501.59

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人公告：

1、董事长杨小舟自2023年2月1日起代行首席信息官职务，董事长杨小舟自2023年2月13日起转任总经理，王亦伟自2023年4月6日起担任董事长职务，总经理杨小舟自2023年6月13日起代行督察长职务，总经理杨小舟自6月14日起兼任首席信息官，史克新自2023年6月16日起担任副总经理职务，督察长任晓伟已于2023年12月12日起恢复履职，总经理杨小舟自2023年12月12日起不再代行督察长职务。上述人事变动已按相关规定备案。

2、公司法定代表人变更为王亦伟，上述变动已完成工商变更登记。

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，报告期内支付报酬50,000.00元人民币。截止本报告期末，该事务所向本基金提供审计服务6年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人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	160,176,203.71	17.30%	120,340.57	17.15%	-
开源证券	1	220,857,233.96	23.85%	168,542.50	24.02%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金融	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	544,893,715.58	58.85%	412,910.65	58.84%	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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未发生变化。

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

无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年第4季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20

2	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-03
3	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-15
4	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-15
5	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年年度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-07
7	富荣基金管理有限公司住所变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-12
8	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第1季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24
9	富荣基金管理有限公司关于总经理代为履行督察长职务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-14
10	富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
11	富荣基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-17
12	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第2季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-07-21
13	富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-01

	经理变更公告		
14	富荣基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金更新招募说明书及产品资料概要的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-03
15	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年中期报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-08-31
16	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-08
17	富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书更新及产品资料概要更新的提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-09-16
18	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-13
19	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2023年第3季度报告提示性公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-10-25
20	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-01

	申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告		
21	富荣基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-09
22	富荣基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-14
23	富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增国金证券股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-11-20
24	富荣基金管理有限公司关于督察长恢复履行职务的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-12
25	富荣基金管理有限公司关于系统升级维护的公告	证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-14

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101 - 20231231	90,260,701.90	0.00	0.00	90,260,701.90	97.92%

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；若发生巨额赎回，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额30%以上的部分，基金管理人有权进行延期办理，可能影响投资者赎回业务办理；《基金合同》生效三年后继续存续的，连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低

于五千万元情形的本基金应当按照本基金合同的约定程序进行清算后终止，且无需召开基金份额持有人大会；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

管理人公司住所变更为广东省广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3110房，上述变动已完成工商变更登记。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会批准富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 13.1.2 《富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 13.1.3 《富荣价值精选灵活配置混合型发起式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 报告期内富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

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

富荣基金管理有限公司
二〇二四年三月三十日