

# 富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 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:2022 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2022年3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2021年01月01日起至2021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	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§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	53
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	54
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	63
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	63
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	63

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	63
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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	66
§10 开放式基金份额变动	66
§11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	68
§12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
§13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

## § 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	135,048,293.80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	35,556,523.15份	99,491,770.65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		广州市南沙区海滨路171号南沙金融大厦11楼1101之一J20室	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		杨小舟	李晓鹏

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.furamc.com.cn/">http://www.furamc.com.cn/</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16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	2021年		2020年		2019年	
	富荣价值 精选混合A	富荣价值精 选混合C	富荣价值 精选混合A	富荣价值 精选混合C	富荣价值 精选混合A	富荣价值 精选混合C
本期 已实 现收 益	-2,151,094.70	-3,808,390.88	15,818,017.34	4,027,455.92	713,220.66	-589,776.19
本期 利润	-987,721.19	-6,572,503.30	15,961,080.06	3,260,867.38	671,805.10	1,231,736.91
加权 平均 基金 份额 本期 利润	-0.0367	-0.0959	0.0420	0.1122	0.1051	0.0982
本期 加权 平均 净值 利润 率	-2.53%	-8.68%	2.56%	10.72%	5.89%	11.32%
本期 基金 份额 净值 增长 率	-6.48%	-6.76%	23.85%	23.53%	137.65%	16.42%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2021年末		2020年末		2019年末	

期末可供分配利润	2,300,549.14	-10,363,194.39	268,220.01	-1,136,029.65	5,974,480.43	-2,047,070.82
期末可供分配基金份额利润	0.0647	-0.1042	0.1320	-0.0499	0.6409	-0.1982
期末基金资产净值	49,518,122.36	104,712,950.44	3,026,127.29	25,683,697.28	17,410,929.47	9,436,967.98
期末基金份额净值	1.3927	1.0525	1.4892	1.1288	1.8677	0.9138
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	116.32%	5.25%	131.31%	12.88%	86.77%	-8.62%

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	-3.13%	0.79%	1.35%	0.44%	-4.48%	0.35%
过去六个月	-6.60%	0.61%	-1.77%	0.56%	-4.83%	0.05%
过去一年	-6.48%	0.56%	-0.66%	0.65%	-5.82%	-0.09%
过去三年	175.25%	3.88%	40.73%	0.71%	134.52%	3.17%
自基金合同生效起至今	116.32%	3.67%	33.20%	0.72%	83.12%	2.95%

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	-3.20%	0.79%	1.35%	0.44%	-4.55%	0.35%
过去六个月	-6.73%	0.61%	-1.77%	0.56%	-4.96%	0.05%
过去一年	-6.76%	0.56%	-0.66%	0.65%	-6.10%	-0.09%
过去三年	34.09%	1.17%	40.73%	0.71%	-6.64%	0.46%
自基金合同生效起至今	5.25%	1.17%	33.20%	0.72%	-27.95%	0.45%

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-2021年12月31日)



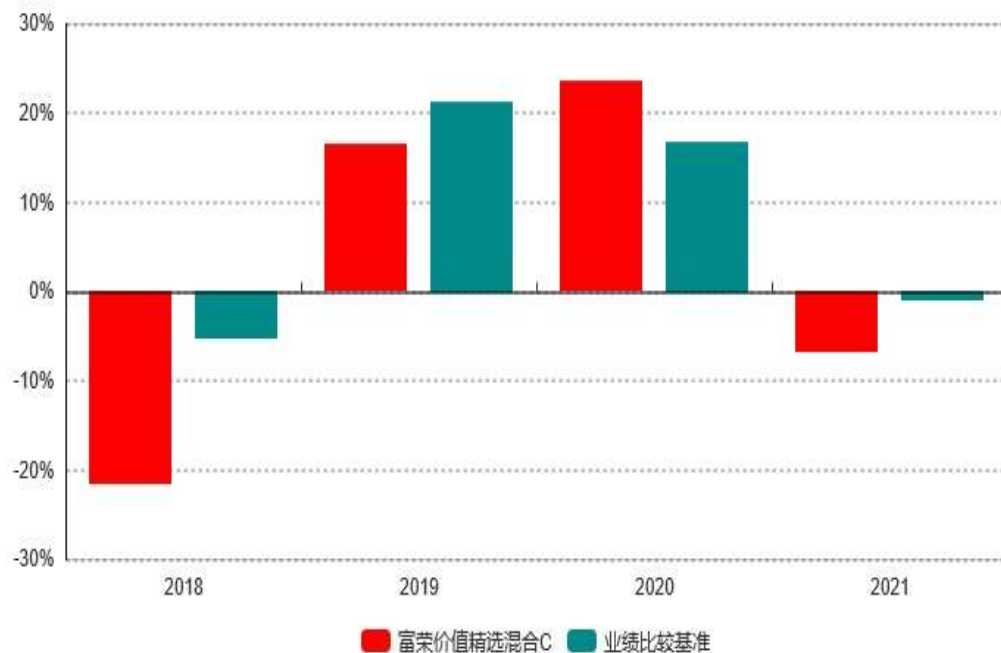
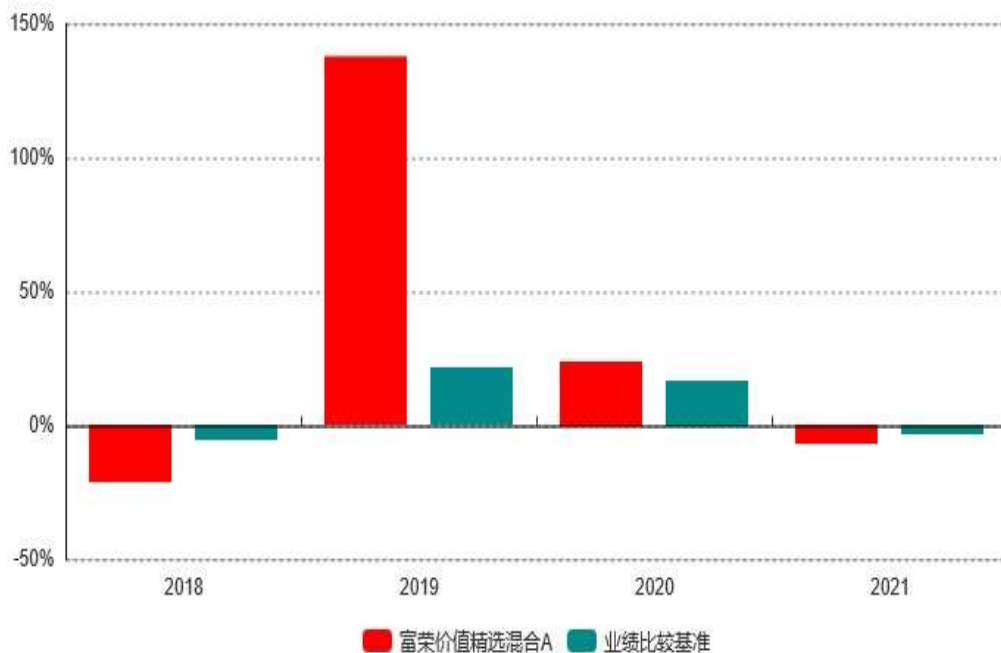
富荣价值精选混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年08月10日-2021年12月31日)



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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



注：本基金合同于 2018 年 8 月 10 日生效，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

## 富荣价值精选混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020年	7.422	782,643,589.85	478,954.82	783,122,544.67	-
合计	7.422	782,643,589.85	478,954.82	783,122,544.67	-

## § 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		
王丹	基金经理	2020-05-12	2021-11-12	10	北京大学工商管理硕士，厦门大学理学学士，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任寰富投资咨询上海有限公司金融衍生品交易员，长盛基金管理有限公司债券交易员，嘉实基金管理有限公司投资经

					理，华融证券股份有限公司固收研究、交易主管。2019年6月21日加入富荣基金。
郎骋成	研究部总经理、基金经理	2020-10-23	2021-11-12	15	硕士研究生，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任锦泰期货有限公司宏观和化工研究员、金东矿业股份有限公司主持上市办公室工作、弘业期货股份有限公司投资咨询负责人及研究所所长、摩根士丹利华鑫基金另类投资小组副组长/专户投资经理/专户理财部副总监。2020年6月加入富荣基金。
黄祥斌	投资一部总经理，基金经理	2021-11-12	-	15	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。

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

本基金主要从分析宏观经济、流动性环境、投资者风险偏好、产业政策等，来判断市场大势，进而决定仓位和主要的行业配置。进而根据行业竞争格局，各家公司不同的资源禀赋，确定行业内的具体品种。一般来说，行业龙头个股具备独特的竞争优势，具备首选的基础。最后从均衡角度出发，在配置进攻类资产的同时，适当配置一些防御仓位。

报告期内，尽管市场风格变化较大，但本基金秉承绝对收益理念审慎进行资产配置，力求保持组合长期的稳定性。报告期内，本基金仓位基本保持稳定。

近期行情表现不佳，分析其原因可能主要受到两方面因素的影响，其一在于宽松政策力度低于预期，比如M1、M2数据、居民中长期贷款低于预期，引发投资者对于经济前景以及流动性前景的担忧。其三在于美联储的系列操作使得投资者做多的理由变得不充分。

展望未来能够对市场产生影响的主要因素中，鉴于央行降低利率且多次明确表态，对国内诸如经济增速、流动性环境等担忧相信会趋于缓和。但是就美联储系列操作的担忧至今未有明确缓解信号，当然可以观察到近期美元指数走弱及人民币汇率保持强势，所以短期内该因素对于市场影响有限。未来重点观测的时点可能为3月中旬美联储议息会议的表态及后续操作。

#### 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1.3927元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.48%，同期业绩比较基准收益率为-0.66%；截至报告期末富荣价值精选混合C基金份额净值为1.0525元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.76%，同期业绩比较基准收益率为-0.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为对A股市场起决定作用的依然是国内的经济政策，从“稳增长”放于首位的系列表态看，2022年对市场的表现理应保持相对乐观的态度。经济政策层面，2022年相对2021年会友好很多，货币财政政策继续宽松是大概率事件。其次，流动性环境相信也会逐步改善，来自于房地产销售好转及稳增长政策效果的体现，A股市场所处的流动性环境相信会有大幅好转。最后，经济触底回稳的概率大。如此，隐忧只剩下美联储的系列举措给资产价格带来的负面影响。从历史数据看，美联储加息、缩表等操作对于全球资产价格影响最强的时间点为预期到兑现时段，所以如果3-4月市场能够出现一定幅度调整的话，相信新的行情会浮现。

本产品权益部分资金大致会按照进攻、防御、机动的阵型来配置。其中进攻仓位主要以新能源、新能源汽车、基建、银行、地产、芯片、军工为主。防御仓位主要集中在大消费领域，涉及到白酒、医药、免税、机场、酒店等。

#### 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；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2021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2021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（2022）审字第61475609_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2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）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2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。
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	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

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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：</p> <p>（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，就可能对</p>

	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。
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	吴翠蓉、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16层
审计报告日期	2022-03-29

## § 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：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	9,758,978.71	746,719.15
结算备付金		3,922,130.25	114,602.64
存出保证金		78,411.87	10,775.16
交易性金融资产	7.4.7.2	140,850,565.61	16,648,445.70
其中：股票投资		140,850,565.61	8,650,001.00
基金投资		-	-
债券投资		-	7,998,444.70

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		471,565.64	13,408,074.30
应收利息	7.4.7.5	4,142.89	317,474.93
应收股利		-	-
应收申购款		1,701.43	11,190.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		155,087,496.40	31,257,281.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,183,898.09
应付赎回款		1,955.08	191,249.14
应付管理人报酬		86,776.98	14,928.30
应付托管费		14,462.84	2,488.08
应付销售服务费		27,962.99	6,649.31
应付交易费用	7.4.7.7	665,265.71	47,446.10
应交税费		-	700.21
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	60,000.00	100,098.12
负债合计		856,423.60	2,547,457.35

<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	135,048,293.80	24,784,660.44
未分配利润	7.4.7.10	19,182,779.00	3,925,164.13
所有者权益合计		154,231,072.80	28,709,824.57
负债和所有者权益总计		155,087,496.40	31,257,281.92

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额135,048,293.80份。A类基金份额净值人民币1.3927元，基金份额总额35,556,523.15份。C类基金份额净值人民币1.0525元，基金份额总额99,491,770.65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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
<b>一、收入</b>		-5,114,474.90	24,368,781.97
1. 利息收入		2,099,650.81	20,577,492.39
其中：存款利息收入	7.4.7.11	441,382.37	3,310,184.98
债券利息收入		1,369,984.72	13,254,488.07
资产支持证券利息收入		-	6,849.84
买入返售金融资产收入		288,283.72	4,005,969.50
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,747,687.31	-5,257,452.42
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-5,389,944.88	2,997,953.76
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	-500,854.10	-8,246,175.82
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.3	-	-11,634.16
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	143,111.67	2,403.80
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,600,738.91	-623,525.82
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	134,300.51	9,672,267.82
<b>减：二、费用</b>		2,445,749.59	5,146,834.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	690,480.67	3,834,985.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	115,080.02	639,164.25
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	227,312.14	90,569.44
4. 交易费用	7.4.7.18	1,305,064.84	415,077.66
5. 利息支出		2,474.79	-
其中：卖出回购金融资产 支出		2,474.79	-
6. 税金及附加		2,278.72	37,419.44
7. 其他费用	7.4.7.19	103,058.41	129,618.25
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-7,560,224.49	19,221,947.44
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-7,560,224.49	19,221,947.44

### 7.3 所有者权益（基金净值）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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	24,784,660.44	3,925,164.13	28,709,824.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,560,224.49	-7,560,224.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	110,263,633.36	22,817,839.36	133,081,472.72
其中：1. 基金申购款	160,965,718.12	41,870,419.38	202,836,137.50
2. 基金赎回款	-50,702,084.76	-19,052,580.02	-69,754,664.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	135,048,293.80	19,182,779.00	154,231,072.80
项 目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	19,649,073.18	7,198,824.27	26,847,897.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利	-	19,221,947.44	19,221,947.44



润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	5,135,587.26	760,626,937.09	765,762,524.35
其中:1.基金申购款	1,929,110,724.41	1,572,473,028.30	3,501,583,752.71
2.基金赎回款	-1,923,975,137.15	-811,846,091.21	-2,735,821,228.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-783,122,544.67	-783,122,544.67
五、期末所有者权益(基金净值)	24,784,660.44	3,925,164.13	28,709,824.57

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:

高峰

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,注册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)、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

本基金的财务报表按照财政部颁布的《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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要为股票、债券和资产支持证券等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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

##### 初始确认

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，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

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。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

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。

#### 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。

本基金持有的股票、债券和资产支持证券等投资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。

(2) 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。

(3) 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，应优先使用相关可观察输入值，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。

(4) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍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，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(5) 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

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额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)占基金净值比例计算的金额。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)占基金净值比例计算的金额。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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并

将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他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。

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额计入当期费用。

#### 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) 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；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 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。

##### (2) 增值税及附加、企业所得税

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。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司

或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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费附加,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费附加。

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

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得,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,暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	9,758,978.71	746,719.15
定期存款	-	-
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	-	-
合计	9,758,978.71	746,719.15

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末



		2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		142,371,322.79	140,850,565.61	-1,520,757.18
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		142,371,322.79	140,850,565.61	-1,520,757.18
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		8,520,118.93	8,650,001.00	129,882.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	8,048,345.04	7,998,444.70	-49,900.34
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,048,345.04	7,998,444.70	-49,900.34
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		16,568,463.97	16,648,445.70	79,981.73

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	2,177.64	893.27
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,926.53	115,954.11
应收债券利息	-	203,318.16
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-2,695.89
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	38.72	5.28
合计	4,142.89	317,474.93

注：其他为应收保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	664,995.51	47,446.10
银行间市场应付交易费用	270.20	-
合计	665,265.71	47,446.10

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	98.12
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	60,000.00	50,000.00
预提信息披露费	-	50,000.00
合计	60,000.00	100,098.12

## 7.4.7.9 实收基金

## 7.4.7.9.1 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 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,032,042.03	2,032,042.03
本期申购	69,857,112.64	69,857,112.64
本期赎回(以“-”号填列)	-36,332,631.52	-36,332,631.52
本期末	35,556,523.15	35,556,523.15

## 7.4.7.9.2 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 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	22,752,618.41	22,752,618.41
本期申购	91,108,605.48	91,108,605.48
本期赎回(以“-”号填列)	-14,369,453.24	-14,369,453.24
本期末	99,491,770.65	99,491,770.65

注:赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 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	268,220.01	725,865.25	994,085.26
本期利润	-2,151,094.70	1,163,373.51	-987,721.19
本期基金份额交易产生的变动数	4,183,423.83	9,771,811.31	13,955,235.14
其中:基金申购款	6,404,610.45	25,273,179.49	31,677,789.94
基金赎回款	-2,221,186.62	-15,501,368.18	-17,722,554.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,300,549.14	11,661,050.07	13,961,599.21

##### 7.4.7.10.2 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	-1,136,029.65	4,067,108.52	2,931,078.87
本期利润	-3,808,390.88	-2,764,112.42	-6,572,503.30
本期基金份额交易产生的变动数	-5,418,773.86	14,281,378.08	8,862,604.22
其中:基金申购款	-6,568,805.47	16,761,434.91	10,192,629.44
基金赎回款	1,150,031.61	-2,480,056.83	-1,330,025.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,363,194.39	15,584,374.18	5,221,179.79

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	82,569.63	499,115.95
定期存款利息收入	-	873,500.00
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	358,446.37	1,936,650.84
其他	366.37	918.19
合计	441,382.37	3,310,184.98

注：其他为交易保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	441,537,041.57	152,524,221.25
减：卖出股票成本总额	446,926,986.45	149,526,267.49
买卖股票差价收入	-5,389,944.88	2,997,953.76

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	-500,854.10	-8,246,175.82
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	-500,854.10	-8,246,175.82

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	341,876,380.35	3,069,274,924.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	338,797,164.11	3,034,676,319.40
减：应收利息总额	3,580,070.34	42,844,780.54
买卖债券差价收入	-500,854.10	-8,246,175.82

## 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	2,895,421.18
减：卖出资产支持证券成本总额	-	2,900,000.00
减：应收利息总额	-	7,055.34
资产支持证券投资收益	-	-11,634.16

## 7.4.7.14 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。

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	143,111.67	2,403.80

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	143,111.67	2,403.80

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,600,738.91	-623,525.82
——股票投资	-1,650,639.25	-573,625.48
——债券投资	49,900.34	-49,900.34
——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	-1,600,738.91	-623,525.82

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
基金赎回费收入	134,300.51	9,633,909.61
转换费收入	-	38,358.21
合计	134,300.51	9,672,267.82

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	1,301,914.84	396,360.16
银行间市场交易费用	3,150.00	18,717.50
合计	1,305,064.84	415,077.66

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	-	50,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	6,958.41	17,318.25
账户维护费	34,900.00	12,000.00
查询费	1,200.00	300.00
合计	103,058.41	129,618.25

#### 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、注册登记机构、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 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	690,480.67	3,834,985.49
其中：支付销售机构的客户维护费	10,341.62	1,861,445.45

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%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	115,080.02	639,164.25

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按基金资产净值的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	本期 2021年01月01日至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

名称	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	222,285.29	222,285.29
合计	0.00	222,285.29	222,285.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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	77,973.36	77,973.36
合计	0.00	77,973.36	77,973.36

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费。本基金C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{基金份额的销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

#### 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 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020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	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00

减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
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	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	19,117,644.14	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	19,117,644.14
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	10,722,426.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额	8,395,218.14	19,117,644.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.44%	84.02%

注：1. 赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 对于分类基金，比例的分母采用各自类别的总份额。

3. 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。

4. 基金管理人于2018年8月7日运用自有资金10,000,000.00元认购本基金C类份额，并作为本基金的发起资金，自本基金合同生效之日起，持有期限不低于3年。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年01月01日至2020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	9,758,978.71	82,569.63	746,719.15	499,115.95

有限公司				
------	--	--	--	--

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的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（2021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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股流通受限	41.98	41.98	1,482	62,214.36	62,214.36	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	10.52	10.52	4,642	48,833.84	48,833.84	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	25.80	33.65	382	9,855.60	12,854.30	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新股流通受限	12.03	17.12	636	7,651.08	10,888.32	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股流通受限	27.12	30.58	260	7,051.20	7,950.80	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	274	7,630.90	7,524.04	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	66.18	56.62	126	8,338.68	7,134.12	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

注：上述股票的限售期限为自上市公司首次公开发行并上市之日起6个月，“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项

清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2021年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.00%（2020年12月31日：16.03%）。

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	3,395,760.00
合计	-	3,395,760.00

注：1. 债券评级取自第三方评级的债项评级。

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

3. 债券投资以净价列示。

#### 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。

#### 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。

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	3,510,750.00
AAA以下	-	1,091,934.70
未评级	-	-

合计	-	4,602,684.70
----	---	--------------

注:1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债及央行票据。

3. 债券投资以净价列示。

#### 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。

#### 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。

#### 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严格按照《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，除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）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约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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。



#### 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 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,758,978.71	-	-	-	9,758,978.71
结算备付金	3,922,130.25	-	-	-	3,922,130.25
存出保证金	78,411.87	-	-	-	78,411.87
交易性金融资产	-	-	-	140,850,565.61	140,850,565.61
应收证券清算款	-	-	-	471,565.64	471,565.64
应收利息	-	-	-	4,142.89	4,142.89
应收申购款	-	-	-	1,701.43	1,701.43
资产总计	13,759,520.83	-	-	141,327,975.57	155,087,496.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,955.08	1,955.08
应付管理人报酬	-	-	-	86,776.98	86,776.98
应付托管费	-	-	-	14,462.84	14,462.84
应付销售服务费	-	-	-	27,962.99	27,962.99
应付交易费用	-	-	-	665,265.71	665,265.71
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	856,423.60	856,423.60
利率敏感度缺口	13,759,520.83	-	-	不适用	不适用
上年度末 2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	746,719.15	-	-	-	746,719.15
结算备付金	114,602.64	-	-	-	114,602.64
存出保证金	10,775.16	-	-	-	10,775.16
交易性金融资产	7,998,444.70	-	-	8,650,001.00	16,648,445.70

应收证券清算款	-	-	-	13,408,074.30	13,408,074.30
应收利息	-	-	-	317,474.93	317,474.93
应收申购款	-	-	-	11,190.04	11,190.04
资产总计	8,870,541.65	-	-	22,386,740.27	31,257,281.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,183,898.09	2,183,898.09
应付赎回款	-	-	-	191,249.14	191,249.14
应付管理人报酬	-	-	-	14,928.30	14,928.30
应付托管费	-	-	-	2,488.08	2,488.08
应付销售服务费	-	-	-	6,649.31	6,649.31
应付交易费用	-	-	-	47,446.10	47,446.10
应交税费	-	-	-	700.21	700.21
其他负债	-	-	-	100,098.12	100,098.12
负债总计	-	-	-	2,547,457.35	2,547,457.35
利率敏感度缺口	8,870,541.65	-	-	不适用	不适用

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	利率上升25个基准点	0.00	-6,790.63
	利率下降25个基准点	0.00	6,806.79

#### 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股票和债券，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 2021年12月31日		上年度末 2020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	140,850,565.61	91.32	8,650,001.00	30.13
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	-	-	7,998,444.70	27.86
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	140,850,565.61	91.32	16,648,445.70	57.99

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

基金业绩比较基准上升5%	4,429,020.97	742,795.34
基金业绩比较基准下降5%	-4,429,020.97	-742,795.34

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 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

###### (1) 公允价值

基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，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中划分为第一层次的余额为人民币140,687,661.34元，划分为第二层次的余额为人民币162,904.27元，无划分为第三层次的余额。（于2020年12月31日，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中划分为第一层次的余额为人民币8,650,001.00元，划分为第二层次的余额为人民币7,998,444.70元，无划分为第三层次的余额。）

###### 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2) 根据《企业会计准则第22号-金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7号）、《企业会计准则第23号-金融资产转移》（财会〔2017〕8号）、《企业会计准则第24号-套期会计》（财会〔2017〕9号）、《企业会计准则第37号-金融工具列报》（财会〔2017〕14号）（以上统称新金融工具相关会计准则），以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号），自2022年1月1日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3) 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2022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	140,850,565.61	90.82
	其中：股票	140,850,565.61	90.82
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	13,681,108.96	8.82
8	其他各项资产	555,821.83	0.36
9	合计	155,087,496.40	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	106,720.00	0.07
B	采矿业	7,548,700.00	4.89
C	制造业	96,564,416.59	62.61

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,502,000.00	0.97
E	建筑业	3,944,713.80	2.56
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,735,200.00	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,337,214.36	2.81
J	金融业	8,620,278.70	5.59
K	房地产业	1,563,000.00	1.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,977,833.84	3.88
N	水利、环境和公共设施管理业	10,888.32	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,939,600.00	4.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	140,850,565.61	91.32

### 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	600519	贵州茅台	4,900	10,045,000.00	6.51
2	601012	隆基股份	90,000	7,758,000.00	5.03
3	002192	融捷股份	58,000	7,548,700.00	4.89
4	601636	旗滨集团	420,093	7,183,590.30	4.66
5	600036	招商银行	139,970	6,817,938.70	4.42
6	600399	抚顺特钢	260,000	6,440,200.00	4.18

7	603678	火炬电子	85,000	6,430,250.00	4.17
8	603259	药明康德	50,000	5,929,000.00	3.84
9	000792	盐湖股份	130,000	4,600,700.00	2.98
10	000858	五粮液	20,000	4,453,200.00	2.89
11	603799	华友钴业	40,000	4,412,400.00	2.86
12	002466	天齐锂业	40,000	4,280,000.00	2.78
13	600763	通策医疗	20,000	3,980,000.00	2.58
14	300655	晶瑞电材	95,000	3,969,100.00	2.57
15	603959	百利科技	250,000	3,940,000.00	2.55
16	600009	上海机场	80,000	3,735,200.00	2.42
17	601966	玲珑轮胎	100,013	3,655,475.15	2.37
18	002179	中航光电	35,000	3,519,600.00	2.28
19	600879	航天电子	400,000	3,296,000.00	2.14
20	000876	新希望	200,000	3,042,000.00	1.97
21	300036	超图软件	100,000	3,005,000.00	1.95
22	300750	宁德时代	5,100	2,998,800.00	1.94
23	002756	永兴材料	20,000	2,960,400.00	1.92
24	300015	爱尔眼科	70,000	2,959,600.00	1.92
25	600741	华域汽车	100,000	2,830,000.00	1.83
26	000661	长春高新	10,000	2,714,000.00	1.76
27	300014	亿纬锂能	20,000	2,363,600.00	1.53
28	603489	八方股份	8,300	1,872,480.00	1.21
29	603345	安井食品	10,000	1,707,800.00	1.11
30	688002	睿创微纳	21,387	1,680,376.59	1.09
31	600048	保利发展	100,000	1,563,000.00	1.01
32	600905	三峡能源	200,000	1,502,000.00	0.97
33	300271	华宇软件	100,000	1,270,000.00	0.82
34	600893	航发动力	20,000	1,269,200.00	0.82
35	600031	三一重工	50,000	1,140,000.00	0.74
36	300059	东方财富	30,000	1,113,300.00	0.72
37	605305	中际联合	10,000	962,900.00	0.62

38	603222	济民医疗	50,000	920,000.00	0.60
39	002142	宁波银行	18,000	689,040.00	0.45
40	002714	牧原股份	2,000	106,720.00	0.07
41	688262	国芯科技	1,482	62,214.36	0.04
42	301136	招标股份	4,642	48,833.84	0.03
43	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
44	301211	亨迪药业	382	12,854.30	0.01
45	301127	天源环保	636	10,888.32	0.01
46	301182	凯旺科技	260	7,950.80	0.01
47	301190	善水科技	274	7,524.04	0.00
48	301189	奥尼电子	126	7,134.12	0.00
49	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
50	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	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	002756	永兴材料	25,995,138.00	90.54
2	603259	药明康德	23,796,030.00	82.88
3	002466	天齐锂业	22,570,372.80	78.62
4	600519	贵州茅台	19,989,665.00	69.63
5	601012	隆基股份	19,503,924.00	67.93
6	601636	旗滨集团	15,013,800.15	52.29
7	000792	盐湖股份	14,204,841.00	49.48
8	002415	海康威视	13,825,805.48	48.16
9	300750	宁德时代	13,346,706.00	46.49
10	688002	睿创微纳	13,117,621.32	45.69
11	603959	百利科技	11,846,456.00	41.26
12	002594	比亚迪	11,556,631.00	40.25



13	002176	江特电机	11,430,882.91	39.82
14	600031	三一重工	11,283,147.00	39.30
15	002812	恩捷股份	11,103,773.00	38.68
16	000876	新希望	10,593,929.00	36.90
17	600036	招商银行	10,220,920.00	35.60
18	000858	五粮液	9,987,136.00	34.79
19	600399	抚顺特钢	9,784,690.00	34.08
20	600276	恒瑞医药	9,440,242.66	32.88
21	002192	融捷股份	9,317,256.00	32.45
22	300015	爱尔眼科	9,087,525.00	31.65
23	603678	火炬电子	8,856,466.50	30.85
24	600763	通策医疗	8,815,924.00	30.71
25	002460	赣锋锂业	8,528,980.00	29.71
26	300712	永福股份	8,125,499.00	28.30
27	601966	玲珑轮胎	7,609,162.61	26.50
28	601633	长城汽车	7,561,032.00	26.34
29	603799	华友钴业	6,946,759.00	24.20
30	003022	联泓新科	6,601,897.00	23.00
31	601888	中国中免	6,439,143.00	22.43
32	600009	上海机场	6,326,451.00	22.04
33	600905	三峡能源	6,254,408.00	21.78
34	000651	格力电器	6,186,957.20	21.55
35	300274	阳光电源	6,179,525.00	21.52
36	002007	华兰生物	6,087,722.34	21.20
37	603345	安井食品	6,062,581.00	21.12
38	002179	中航光电	5,587,867.00	19.46
39	603489	八方股份	5,381,406.00	18.74
40	300036	超图软件	5,166,675.00	18.00
41	300124	汇川技术	5,129,756.00	17.87
42	600048	保利发展	5,047,516.00	17.58
43	600660	福耀玻璃	4,804,275.00	16.73

44	000661	长春高新	4,753,169.00	16.56
45	300059	东方财富	4,580,747.82	15.96
46	300655	晶瑞电材	4,522,990.00	15.75
47	000831	五矿稀土	4,271,685.00	14.88
48	300271	华宇软件	4,222,296.83	14.71
49	600741	华域汽车	4,131,649.84	14.39
50	600406	国电南瑞	3,943,959.00	13.74
51	601318	中国平安	3,824,790.00	13.32
52	600585	海螺水泥	3,810,498.00	13.27
53	603444	吉比特	3,774,478.00	13.15
54	601166	兴业银行	3,651,771.00	12.72
55	300850	新强联	3,347,600.00	11.66
56	601865	福莱特	3,316,535.00	11.55
57	300379	东方通	3,300,000.00	11.49
58	603986	兆易创新	3,279,200.00	11.42
59	600879	航天电子	3,218,325.00	11.21
60	600309	万华化学	3,128,397.00	10.90
61	688190	云路股份	2,754,571.68	9.59
62	000538	云南白药	2,740,894.00	9.55
63	300014	亿纬锂能	2,544,420.00	8.86
64	300595	欧普康视	2,514,530.00	8.76
65	000895	双汇发展	2,484,792.00	8.65
66	603290	斯达半导	2,461,230.00	8.57
67	603866	桃李面包	2,358,849.00	8.22
68	000333	美的集团	2,254,007.17	7.85
69	000977	浪潮信息	2,233,578.00	7.78
70	600171	上海贝岭	2,230,872.00	7.77
71	000063	中兴通讯	2,221,705.00	7.74
72	600754	锦江酒店	2,214,399.00	7.71
73	600196	复星医药	2,169,545.00	7.56
74	002340	格林美	2,161,729.00	7.53

75	300724	捷佳伟创	2,143,263.00	7.47
76	300821	东岳硅材	2,058,000.00	7.17
77	605305	中际联合	2,052,800.00	7.15
78	601899	紫金矿业	2,016,000.00	7.02
79	000002	万科A	1,938,000.00	6.75
80	000961	中南建设	1,917,676.00	6.68
81	603899	晨光文具	1,872,632.00	6.52
82	300782	卓胜微	1,838,420.00	6.40
83	600809	山西汾酒	1,812,063.00	6.31
84	002511	中顺洁柔	1,790,000.00	6.23
85	603096	新经典	1,389,799.00	4.84
86	002027	分众传媒	1,246,047.20	4.34
87	600887	伊利股份	1,240,520.00	4.32
88	600893	航发动力	1,226,641.00	4.27
89	300896	爱美客	1,157,991.00	4.03
90	300003	乐普医疗	1,125,062.00	3.92
91	600867	通化东宝	1,069,369.00	3.72
92	600690	海尔智家	1,045,565.00	3.64
93	000338	潍柴动力	972,970.00	3.39
94	603501	韦尔股份	929,582.00	3.24
95	603222	济民医疗	790,400.00	2.75
96	600038	中直股份	726,503.00	2.53
97	002142	宁波银行	685,686.70	2.39
98	600030	中信证券	676,962.00	2.36
99	002475	立讯精密	587,710.00	2.05

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	002756	永兴材料	26,518,988.00	92.37
2	603259	药明康德	18,513,647.43	64.49
3	002466	天齐锂业	17,163,273.00	59.78
4	002415	海康威视	14,799,702.00	51.55
5	300750	宁德时代	11,295,230.98	39.34
6	601012	隆基股份	11,185,456.10	38.96
7	002594	比亚迪	11,162,477.00	38.88
8	688002	睿创微纳	11,006,931.26	38.34
9	600519	贵州茅台	10,881,820.30	37.90
10	002176	江特电机	10,783,596.31	37.56
11	000792	盐湖股份	10,406,349.00	36.25
12	002812	恩捷股份	10,313,116.00	35.92
13	600031	三一重工	9,845,304.65	34.29
14	601636	旗滨集团	9,148,854.00	31.87
15	600276	恒瑞医药	9,044,088.85	31.50
16	002460	赣锋锂业	8,283,013.44	28.85
17	300712	永福股份	8,110,536.00	28.25
18	000876	新希望	7,300,538.00	25.43
19	601633	长城汽车	6,645,330.00	23.15
20	000651	格力电器	6,586,263.15	22.94
21	603959	百利科技	6,426,569.00	22.38
22	601888	中国中免	6,408,518.25	22.32
23	300015	爱尔眼科	6,100,543.00	21.25
24	002007	华兰生物	6,008,793.00	20.93
25	003022	联泓新科	5,896,833.00	20.54
26	300274	阳光电源	5,549,425.00	19.33
27	000858	五粮液	5,366,478.85	18.69
28	300124	汇川技术	5,069,169.14	17.66
29	000831	五矿稀土	4,583,149.00	15.96
30	600660	福耀玻璃	4,572,951.00	15.93

31	600905	三峡能源	4,567,000.00	15.91
32	300059	东方财富	4,247,750.00	14.80
33	600585	海螺水泥	4,203,287.32	14.64
34	600763	通策医疗	4,149,624.00	14.45
35	603345	安井食品	4,112,778.00	14.33
36	601966	玲珑轮胎	4,037,430.77	14.06
37	603489	八方股份	3,938,270.00	13.72
38	603444	吉比特	3,867,654.00	13.47
39	601166	兴业银行	3,719,189.00	12.95
40	600048	保利发展	3,638,783.00	12.67
41	600406	国电南瑞	3,622,530.00	12.62
42	601318	中国平安	3,405,085.62	11.86
43	300271	华宇软件	3,358,916.00	11.70
44	300379	东方通	3,241,315.00	11.29
45	600399	抚顺特钢	3,228,743.00	11.25
46	600009	上海机场	3,136,176.16	10.92
47	300850	新强联	3,102,000.00	10.80
48	600309	万华化学	3,077,005.36	10.72
49	603986	兆易创新	3,066,216.00	10.68
50	601865	福莱特	3,016,899.00	10.51
51	600036	招商银行	2,965,689.36	10.33
52	600754	锦江酒店	2,912,988.00	10.15
53	000538	云南白药	2,652,136.00	9.24
54	300724	捷佳伟创	2,455,094.00	8.55
55	603290	斯达半导	2,428,272.00	8.46
56	688190	云路股份	2,417,681.03	8.42
57	300595	欧普康视	2,411,419.00	8.40
58	603866	桃李面包	2,402,536.00	8.37
59	000333	美的集团	2,361,925.28	8.23
60	000895	双汇发展	2,322,816.00	8.09
61	000063	中兴通讯	2,217,225.00	7.72

62	600196	复星医药	2,214,400.00	7.71
63	002179	中航光电	2,212,807.00	7.71
64	002340	格林美	2,207,190.00	7.69
65	000977	浪潮信息	2,145,476.00	7.47
66	300782	卓胜微	2,142,813.00	7.46
67	000661	长春高新	2,092,706.00	7.29
68	300036	超图软件	2,046,711.00	7.13
69	300821	东岳硅材	1,970,616.00	6.86
70	603678	火炬电子	1,935,502.00	6.74
71	600171	上海贝岭	1,921,489.00	6.69
72	000961	中南建设	1,918,582.00	6.68
73	601899	紫金矿业	1,915,000.00	6.67
74	000002	万科A	1,913,000.00	6.66
75	603799	华友钴业	1,862,770.00	6.49
76	600809	山西汾酒	1,862,400.00	6.49
77	603899	晨光文具	1,764,151.00	6.14
78	002511	中顺洁柔	1,730,000.00	6.03
79	600741	华域汽车	1,580,040.00	5.50
80	002192	融捷股份	1,559,166.00	5.43
81	603096	新经典	1,327,576.00	4.62
82	300896	爱美客	1,127,804.00	3.93
83	605305	中际联合	1,124,000.00	3.92
84	300003	乐普医疗	1,117,250.00	3.89
85	600867	通化东宝	1,062,881.00	3.70
86	300760	迈瑞医疗	1,060,492.00	3.69
87	600887	伊利股份	968,403.48	3.37
88	600690	海尔智家	929,830.00	3.24
89	002027	分众传媒	923,670.36	3.22
90	603501	韦尔股份	918,304.00	3.20
91	002475	立讯精密	880,317.74	3.07
92	000001	平安银行	841,921.40	2.93

93	600900	长江电力	809,324.52	2.82
94	000338	潍柴动力	806,690.43	2.81
95	600038	中直股份	747,228.00	2.60
96	600030	中信证券	720,720.00	2.51

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	580,778,190.31
卖出股票收入（成交）总额	441,537,041.57

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

##### 8.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 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中，招商银行股份有限公司在报告编制一年内曾经受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。青海盐湖股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的行政处罚。本基金对上述市场发行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，本基金投资的其它个股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	78,411.87
2	应收证券清算款	471,565.64
3	应收股利	-
4	应收利息	4,142.89
5	应收申购款	1,701.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	555,821.83



**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	364	97,682.76	34,479,624.11	96.9713%	1,076,899.04	3.0287%
富荣价值精选混合C	717	138,761.19	98,655,920.04	99.1599%	835,850.61	0.8401%
合计	1,050	128,617.42	133,135,544.15	98.5837%	1,912,749.65	1.4163%

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

### 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

## § 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	2,032,042.03	22,752,618.41
本报告期基金总申购份额	69,857,112.64	91,108,605.48
减：本报告期基金总赎回份额	36,332,631.52	14,369,453.24
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,556,523.15	99,491,770.65

## § 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：副总经理苏春华于2021年3月19日离任；总经理高峰于2021年6月22日兼任首席信息官。上述人事变动已按相关规定备案。

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

本报告期内涉及本基金管理人与劳动者诉讼案例一起，对管理人及基金运作无重大影响。

本报告期内无涉及基金财产、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60,000.00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4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

本报告期内本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚等情况。

### 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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	12,877,122.55	1.26%	9,674.75	1.26%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金融	1	230,380,031.22	22.56%	173,084.76	22.56%	-

方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	778,005,229.85	76.18%	584,513.58	76.18%	-
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。（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

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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	5,103,866.15	5.27%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融	46,853,124.20	48.37%	5,700,000.00	1.32%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	44,902,862.84	46.36%	425,000,000.00	98.68%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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2020年第4季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-01-22
2	富荣基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-03-20
3	富荣基金管理有限公司旗下	中国证券报、上海证券报、	2021-03-31

	全部基金2020年年度报告提示性公告	证券时报、证券日报	
4	富荣基金管理有限公司关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-04-19
5	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年第1季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-04-22
6	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-05-06
7	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财咨道信息技术有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-05-26
8	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加财咨道信息技术有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-05-26
9	富荣基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-06-24
10	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-06-29
11	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京度小满基金销售有限公司基金申	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-06-29

	购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告		
12	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增通华财富（上海）基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-07-02
13	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加通华财富（上海）基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-07-02
14	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海万得基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-07-21
15	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-07-21
16	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年第2季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-07-21
17	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海长量基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报	2021-07-21
18	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量基金销售有限公司为销售机	中国证券报、证券时报	2021-07-21

	构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告		
19	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-07-23
20	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-07-23
21	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2021-07-30
22	富荣基金管理有限公司关于恢复泰信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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-08-27
23	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年中期报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-08-31
24	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加众惠基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-09-08
25	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众惠基金销售有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-09-08

26	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	2021-09-17
27	富荣基金管理有限公司关于基金经理休假由他人代为履职的公告	证券时报、证券日报	2021-10-13
28	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年第3季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-10-27
29	富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	证券时报	2021-11-13
30	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	2021-11-17
31	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-11-26
32	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021-11-26
33	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	2021-11-29
34	富荣基金管理有限公司关于调整富荣价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金	证券时报	2021-11-29



	最低持有份额的公告		
35	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	上海证券报、证券时报	2021-12-31
36	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报	2021-12-31

## § 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	20210101 - 20210804	19,117,644.14	0.00	10,722,426.00	8,395,218.14	6.22%
	2	20210128 - 20211231	0.00	90,260,701.90	0.00	90,260,701.90	66.84%
	3	20210805 - 20211231	0.00	68,831,910.79	34,400,000.00	34,431,910.79	25.50%
产品特有风险							
<p>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；基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于 2 亿元的，本基金合同应当终止；《基金合同》生效后继续存续的，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。</p>							

## § 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  
二〇二二年三月三十一日