

富荣富乾债券型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 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:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2023 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03月24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2022年01月01日起至2022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 | 13 |
| 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 | 14 |
| 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 | 15 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 15 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16 |
| 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 | 16 |
| §6 审计报告 | 16 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 16 |
| §7 年度财务报表 | 19 |
| 7.1 资产负债表 | 19 |
| 7.2 利润表 | 21 |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表 | 23 |
| 7.4 报表附注 | 25 |
| §8 投资组合报告 | 54 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 54 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 55 |
| 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 | 56 |
| 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 | 58 |
| 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 | 59 |
| 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 | 59 |
| 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 | 59 |

| | |
|------------------------------------|----|
| 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 | 59 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 59 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 59 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 60 |
| §9 基金份额持有人信息 | 61 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 61 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 61 |
| 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 | 62 |
| §10 开放式基金份额变动 | 62 |
| §11 重大事件揭示 | 62 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 62 |
| 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 | 62 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 63 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 63 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 63 |
| 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 | 63 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 63 |
| 11.8 其他重大事件 | 64 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 70 |
| 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 | 70 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 70 |
| §13 备查文件目录 | 70 |
| 13.1 备查文件目录 | 70 |
| 13.2 存放地点 | 71 |
| 13.3 查阅方式 | 71 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------|---------|
| 基金名称 | 富荣富乾债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 富荣富乾债券 | |
| 基金主代码 | 004792 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018年02月07日 | |
| 基金管理人 | 富荣基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 149,782,263.53份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 富荣富乾债券A | 富荣富乾债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004792 | 004793 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 149,782,238.09份 | 25.44份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在一定程度上控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金以中长期利率趋势分析为基础，结合经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，自上而下决定资产配置及组合久期，并依据内部信用评估体系，深入挖掘价值被低估的标的券种，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数（总财富）收益率*90%+1年期定期存款利率（税后）*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。 |

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 | 上海浦东发展银行股份有限 |

| | | | |
|-------------|------|----------------------------------|--------------------|
| | | | 公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 任晓伟 | 朱萍 |
| | 联系电话 | 0755-84356633 | 021-61618888 |
| | 电子邮箱 | service@furamc.com.cn | zhup02@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-685-5600 | 95528 |
| 传真 | | 0755-83230787 | 021-63602540 |
| 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 | 上海市中山东一路12号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区八卦四路52号安吉尔大厦24层 | 上海市北京东路689号 |
| 邮政编码 | | 518038 | 200001 |
| 法定代表人 | | 杨小舟 | 郑杨 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券日报》 |
| 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楼 |
| 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 | 2022年 | | 2021年 | | 2020年 | |
|---------------|----------------|---------|-----------------|---------|------------------|-----------|
| | 富荣富乾债券A | 富荣富乾债券C | 富荣富乾债券A | 富荣富乾债券C | 富荣富乾债券A | 富荣富乾债券C |
| 本期已实现收益 | -4,482,185.73 | -0.92 | -276,655,885.87 | -5.29 | 78,414,386.83 | 10,607.20 |
| 本期利润 | -4,944,032.71 | -0.91 | -28,337,739.26 | -1.02 | -41,921,018.19 | 14,495.15 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0307 | -0.0365 | -0.0238 | -0.0447 | -0.0161 | 0.0553 |
| 本期加权平均净值利润率 | -3.30% | -4.21% | -2.44% | -4.87% | -1.58% | 5.53% |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.17% | -4.28% | -3.08% | -4.70% | -3.26% | -6.46% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022年末 | | 2021年末 | | 2020年末 | |
| 期末可供分配利润 | -24,776,937.58 | -5.65 | -25,094,643.20 | -4.29 | -33,207,900.46 | -1.51 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1654 | -0.2221 | -0.1361 | -0.1854 | -0.0216 | -0.0654 |
| 期末基金资产净值 | 137,528,546.23 | 21.69 | 174,815,518.27 | 20.61 | 1,507,013,064.94 | 21.59 |
| 期末基金份额净值 | 0.9182 | 0.8526 | 0.9483 | 0.8907 | 0.9784 | 0.9346 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2022年末 | | 2021年末 | | 2020年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | -3.70% | -10.54% | -0.54% | -6.54% | 2.62% | -1.93% |

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

富荣富乾债券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 | -1.06% | 0.18% | 0.02% | 0.07% | -1.08% | 0.11% |
| 过去六个月 | -2.88% | 0.17% | 1.38% | 0.06% | -4.26% | 0.11% |
| 过去一年 | -3.17% | 0.17% | 3.12% | 0.05% | -6.29% | 0.12% |
| 过去三年 | -9.21% | 0.27% | 11.06% | 0.06% | -20.27% | 0.21% |
| 自基金合同 生效起至今 | -3.70% | 0.25% | 23.93% | 0.06% | -27.63% | 0.19% |

富荣富乾债券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 | -1.32% | 0.18% | 0.02% | 0.07% | -1.34% | 0.11% |
| 过去六个月 | -3.49% | 0.17% | 1.38% | 0.06% | -4.87% | 0.11% |
| 过去一年 | -4.28% | 0.17% | 3.12% | 0.05% | -7.40% | 0.12% |
| 过去三年 | -14.66% | 0.27% | 11.06% | 0.06% | -25.72% | 0.21% |
| 自基金合同 生效起至今 | -10.54% | 0.24% | 23.93% | 0.06% | -34.47% | 0.18% |

注：本基金的业绩比较基准为中债综合指数（总财富）收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%

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

富荣富乾债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年02月07日-2022年12月31日)



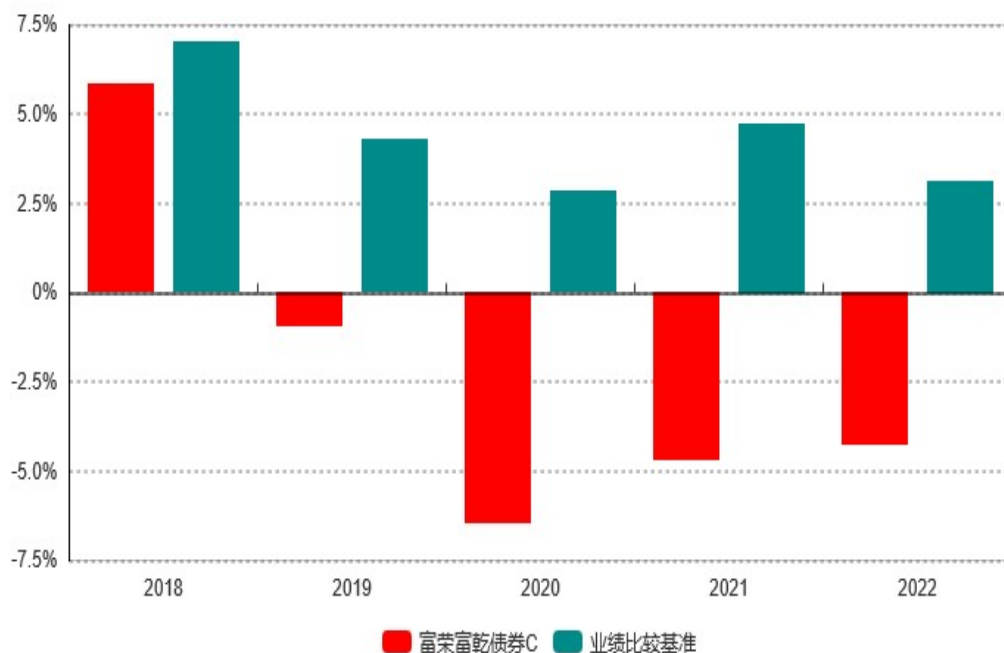
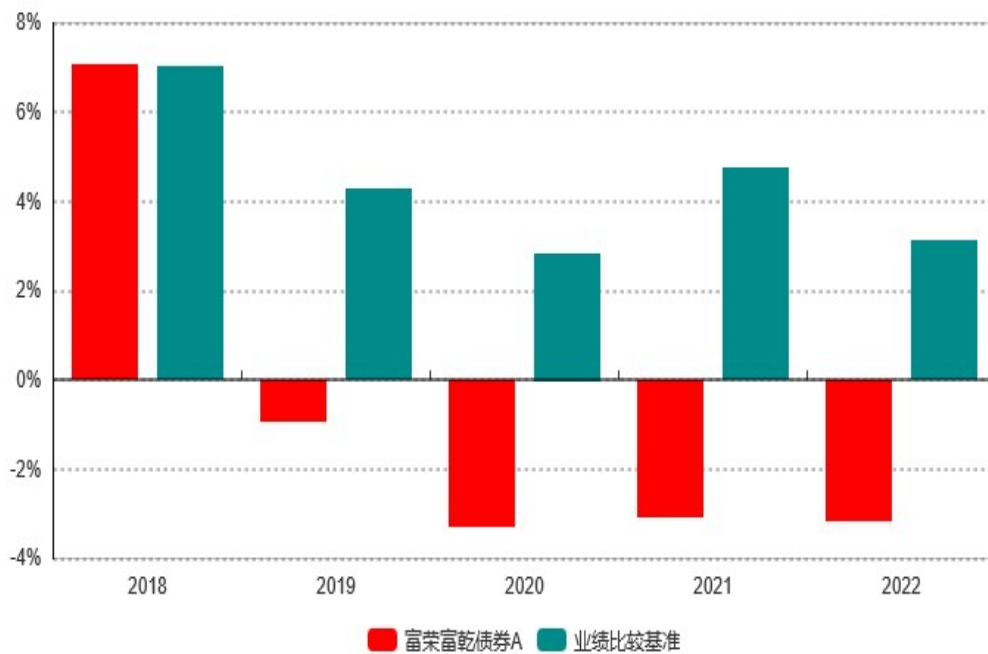
富荣富乾债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年02月07日-2022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2月7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

本基金合同于2018年2月7日生效，截至2022年12月31日止，本基金近三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-----------------|-----------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王丹 | 固定收益部总经理助理、基金经理 | 2019-08-12 | - | 11 | 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。 |

| | | | | | |
|-----|--------------|------------|---|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 黄祥斌 | 投资一部总经理，基金经理 | 2021-12-27 | - | 16 | 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《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

回顾2022年，在国内疫情反复、海外地缘政治冲突、美联储加息等多重因素共同影响下，国内需求较前期低迷，稳增长面临挑战。结构上看，主要是基建、制造业贡献增长，地产仍边际走弱；受疫情反复冲击消费下降明显，外需承压减弱出口拉动作用，工业整体弱复苏，服务业低位运行为主。政策方面，货币政策基本延续前期总基调，流动性保持合理充裕，更多以发挥结构性货币政策工具作用为主；财政政策以稳经济为中心，积极盘活存量资金，推动基建投资增长。具体到国内债市，全年利率更多呈现震荡形态，调整幅度略超预期的两个时间点分别在8月份和11月份。8月中旬，央行超预期下调MLF和7天逆回购利率，债券市场快速下行调整；11月初，债券市场调整叠加理财赎回两者共振形成快速负反馈，债券市场快速上行调整。权益方面，2022年A股市场呈现弱势格局，其中，上证综指下跌15.13%，上证50指数下跌19.52%，沪深300指数下跌21.63%，创业板指数下跌29.37%。从申万一级行业指数看，其中，煤炭、综合、社会服务等板块表现较好，电子、电力设备、传媒等板块表现相对落后。回顾分析，影响市场表现的主要因素如下：首先，美联储紧缩政策的不断加码且力度超出预期，促使投资者担忧人民币汇率以及相关的外资流动方向；其次，国内地产行业的萧条增加了投资者对于经济前景的担忧；最后，人口流动政策的不确定性使得投资者的风险偏好有所下降。

2022年，本基金投资以绝对收益为目标，债券投资为主并辅以权益投资，增加组合收益弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣富乾债券A基金份额净值为0.9182元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.17%，同期业绩比较基准收益率为3.12%；截至报告期末富荣富乾债券C基金份额净值为0.8526元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.28%，同期业绩比较基准收益率为3.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年，国内经济基本面所面临的需求收缩、供给冲击、预期转弱等多重压力仍较大，同时作为开局之年，财政政策和货币政策都将有望进一步提效，疫情扰动平稳后内生动能逐步复苏，适时警惕外部金融风险。防疫政策消化和地产实质性修复节奏仍需等待时间验证，信用风险方面关注部分重点区域财政恢复情况。对于债市而言，经济复苏力度目前看尚处温和，关注核心通胀及大宗商品后续表现情况，预期差反复交易之下，利率可能呈现一定波动放大态势。根据市场最终表现情况，择机适度参与波段交易。信用债方面，信用分层格局可能延续，弱区域城投和敏感行业产业债信用利差仍面临一定扩大压力，配置角度还是以偏高等级、中短久期信用为主，关注市场震荡调整过程中票息策略的机会。权益方面，对2023年的权益市场目前仍报以较好的预期，主要原因如下：首先，基本面不确定性因素在减少；其次，防疫政策的转向在很大程度上提振了投资者的风险偏好。再次，美联储紧缩政策逐步步入尾声，一定程度上相较今年适度降低了汇率及外资流动的风险。最后，政策层在房地产行业出台的相关政策也利于2023年重启宽信用路径的开展。综合来看，权益市场结构性的投资机会较之于2022年可能会相对多一些。从行业层面看，地产产业链及消费产业链未来有望边际好转，是值得重点关注的领域。具体对应的行业是地产、建材、家电、白酒、医药、航空、免税、机场、金融等。

预计2023年，组合仍持续争取在兼顾安全性、流动性的基础上，灵活调整久期；积极把握权益市场结构性机会，灵活进行大类资产配置安排。

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

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的基金份额进行再投资,且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;本基金各类基金份额在费用收取上不同,其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别每一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2022年12月31日,根据上述分配原则及基金实际运作情况,本报告期未有收益分配事项。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形,未出现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,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对富荣富乾债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及

其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对富荣富乾债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由富荣基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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（2023）审字第61475609_H05号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 富荣富乾债券型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了富荣富乾债券型证券投资基金的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的富荣富乾债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了富荣富乾债券型证券投资基金2022年12月31日的财务状况以及2022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，我们独立于富荣富乾债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | 富荣富乾债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估富荣富乾债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督富荣富乾债券型证券投资基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出 |

具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对富荣富乾债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致富荣富乾债券型证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

| | |
|-----------|-------------------------|
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 吴翠蓉、黄伟煌 |
| 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楼 |
| 审计报告日期 | 2023-03-30 |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富荣富乾债券型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 12,479,522.16 | 5,616,630.52 |
| 结算备付金 | | 103,766.58 | - |
| 存出保证金 | | 23,041.50 | 28,104.44 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 125,189,112.47 | 169,855,795.00 |
| 其中：股票投资 | | 13,106,020.00 | 29,791,795.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 112,083,092.47 | 140,064,000.00 |
| 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 | - | 8,960,133.44 |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | - | 3,271,700.07 |
| 资产总计 | | 137,795,442.71 | 187,732,363.47 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021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 | | - | 10,093,874.95 |
| 应付清算款 | | - | 2,501,171.85 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 46,648.53 | 59,499.02 |
| 应付托管费 | | 5,831.06 | 7,437.37 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 214,395.20 | 254,841.40 |
| 负债合计 | | 266,874.79 | 12,916,824.59 |
| 净资产: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 149,782,263.53 | 184,352,272.29 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | -12,253,695.61 | -9,536,733.41 |

| | | | |
|----------|--|----------------|----------------|
| 净资产合计 | | 137,528,567.92 | 174,815,538.88 |
| 负债和净资产总计 | | 137,795,442.71 | 187,732,363.47 |

注：（1）报告截止日2022年12月31日，富荣富乾债券型证券投资基金A类基金份额净值0.9182元，富荣富乾债券型证券投资基金C类基金份额净值0.8526元，基金份额总额149,782,263.53份，其中富荣富乾债券型证券投资基金A类基金份额149,782,238.09份，富荣富乾债券型证券投资基金C类基金份额25.44份。

（2）以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：富荣富乾债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年01月01日至2 022年12月31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日 |
|------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入 | | -4,045,476.27 | -20,850,252.31 |
| 1.利息收入 | | 44,812.28 | 28,255,679.82 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 41,942.79 | 400,337.13 |
| 债券利息收入 | | - | 25,933,035.85 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,869.49 | 1,922,306.84 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -3,628,441.58 | -297,424,083.01 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | -6,846,853.48 | 473,492.10 |
| 基金投资收益 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|-----------------|
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | 2,884,591.89 | -297,914,277.03 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.13 | 333,820.01 | 16,701.92 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.14 | -461,846.97 | 248,318,150.88 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.15 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 898,557.35 | 7,487,487.97 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 601,888.50 | 4,704,116.37 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 75,236.01 | 588,014.49 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 4,411.45 | 1,736,537.54 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,411.45 | 1,736,537.54 |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.16 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | 30,933.16 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.17 | 217,021.39 | 427,886.41 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -4,944,033.62 | -28,337,740.28 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -4,944,033.62 | -28,337,740.28 |

| | | | |
|---------------|--|---------------|----------------|
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -4,944,033.62 | -28,337,740.28 |

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富荣富乾债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年12月31日 | | | |
|----------------------|-------------------------------|--------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 184,352,272.29 | - | -9,536,733.41 | 174,815,538.88 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 184,352,272.29 | - | -9,536,733.41 | 174,815,538.88 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -34,570,008.76 | - | -2,716,962.20 | -37,286,970.96 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -4,944,033.62 | -4,944,033.62 |
| （二）、本期基金份额交易产 | -34,570,008.76 | - | 2,227,071.42 | -32,342,937.34 |

| | | | | |
|------------------------------------------|------------------------------------|--------|----------------|------------------|
| 生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | | | | |
| 其中: 1.基金申购款 | 7.75 | - | -0.77 | 6.98 |
| 2.基金赎回款 | -34,570,016.51 | - | 2,227,072.19 | -32,342,944.32 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 149,782,263.53 | - | -12,253,695.61 | 137,528,567.92 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 1,540,220,988.50 | - | -33,207,901.97 | 1,507,013,086.53 |
| 加: 会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 1,540,220,988.50 | - | -33,207,901.97 | 1,507,013,086.53 |

| | | | | |
|------------------------------------------|-------------------|---|----------------|-------------------|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -1,355,868,716.21 | - | 23,671,168.56 | -1,332,197,547.65 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -28,337,740.28 | -28,337,740.28 |
| (二)、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) | -1,355,868,716.21 | - | 52,008,908.84 | -1,303,859,807.37 |
| 其中：1.基金申购款 | 431,004,381.22 | - | -15,377,101.34 | 415,627,279.88 |
| 2.基金赎回款 | -1,786,873,097.43 | - | 67,386,010.18 | -1,719,487,087.25 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 184,352,272.29 | - | -9,536,733.41 | 174,815,538.88 |

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

富荣富乾债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2017]717号文《关于准予富荣富乾债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人富荣基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2018年2月7日正式生效，首次设立募集规模为202,001,578.43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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“上海浦发银行”）。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、国债期货、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等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）。本基金可以投资于股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证，不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；对权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为中债综合指数（总财富）收益率×90%+1年期定期存款利率（税后）×10%。

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2022年12月31日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年12月31日止期间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

（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) 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按除权日该类基金份额的基金份额净值自动转为该类别基金的份额进行再投资，且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 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。

(3) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权。

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 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

根据《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于2022年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币5,616,630.52元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,005.31元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币5,617,635.83元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币28,104.44元，自应收利息转入的重分类金额为人民币13.86元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币28,118.30元。

买入返售金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币8,960,133.44元，自应收利息转入的重分类金额为人民币2,152.14元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币8,962,285.58元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币3,271,700.07元，转出至银行存款的重分类金额为人民币1,005.31元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币13.86元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币3,268,528.76元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币2,152.14元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币169,855,795.00元，自应收利息转入的重分类金额为人民币3,268,528.76元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币173,124,323.76元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币10,093,874.95元，自应付利息转入的重分类金额为人民币1,275.73元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币10,095,150.68元。

应付利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,275.73元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币1,275.73元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、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，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(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。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）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。

(5) 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 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 12,479,522.16 | 5,616,630.52 |
| 等于：本金 | 12,478,179.30 | 5,616,630.52 |
| 加：应计利息 | 1,342.86 | - |
| 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 | 12,479,522.16 | 5,616,630.52 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | | | | |
|---------------|---------------------|----------------|----------------|----------------|-------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 13,737,738.96 | - | 13,106,020.00 | -631,718.96 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 9,511,760.00 | 192,941.10 | 9,691,991.10 | -12,710.00 |
| | 银行间市场 | 101,097,400.00 | 1,500,101.37 | 102,391,101.37 | -206,400.00 |
| | 合计 | 110,609,160.00 | 1,693,042.47 | 112,083,092.47 | -219,110.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 124,346,898.96 | 1,693,042.47 | 125,189,112.47 | -850,828.96 | |
| 项目 | 上年度末 2021年12月31日 | | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 30,415,546.99 | - | 29,791,795.00 | -623,751.99 | |

| | | | | | |
|---------------|-------|----------------|---|----------------|-------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 139,829,230.00 | - | 140,064,000.00 | 234,770.00 |
| | 合计 | 139,829,230.00 | - | 140,064,000.00 | 234,770.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 170,244,776.99 | - | 169,855,795.00 | -388,981.99 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | |
|-------|---------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | - | - |
| 项目 | 上年度末 2021年12月31日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 8,960,133.44 | - |
| 合计 | 8,960,133.44 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 应收利息 | - | 3,271,700.07 |
| 其他应收款 | - | - |
| 待摊费用 | - | - |
| 合计 | - | 3,271,700.07 |

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 34,395.20 | 43,565.67 |
| 其中：交易所市场 | 33,720.20 | 22,851.10 |
| 银行间市场 | 675.00 | 20,714.57 |
| 应付利息 | - | 1,275.73 |
| 预提费用 | 180,000.00 | 210,000.00 |
| 合计 | 214,395.20 | 254,841.40 |

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 富荣富乾债券A

金额单位：人民币元

| 项目 (富荣富乾债券A) | 本期 2022年01月01日至2022年12月31日 | |
|-----------------|-------------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 184,352,249.15 | 184,352,249.15 |
| 本期申购 | 4.30 | 4.30 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -34,570,015.36 | -34,570,015.36 |

| | | |
|-----|----------------|----------------|
| 本期末 | 149,782,238.09 | 149,782,238.09 |
|-----|----------------|----------------|

7.4.7.7.2 富荣富乾债券C

金额单位：人民币元

| 项目 (富荣富乾债券C) | 本期 2022年01月01日至2022年12月31日 | |
|-----------------|-------------------------------|-------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 23.14 | 23.14 |
| 本期申购 | 3.45 | 3.45 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1.15 | -1.15 |
| 本期末 | 25.44 | 25.44 |

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 富荣富乾债券A

单位：人民币元

| 项目 (富荣富乾债券A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期期初 | -25,094,643.20 | 15,557,912.32 | -9,536,730.88 |
| 本期利润 | -4,482,185.73 | -461,846.98 | -4,944,032.71 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,799,891.35 | -2,572,819.62 | 2,227,071.73 |
| 其中：基金申购款 | -0.66 | 0.34 | -0.32 |
| 基金赎回款 | 4,799,892.01 | -2,572,819.96 | 2,227,072.05 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -24,776,937.58 | 12,523,245.72 | -12,253,691.86 |

7.4.7.8.2 富荣富乾债券C

单位：人民币元

| 项目 (富荣富乾债券C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------|-------|-------|---------|
| 本期期初 | -4.29 | 1.76 | -2.53 |
| 本期利润 | -0.92 | 0.01 | -0.91 |

| | | | |
|----------------|-------|-------|-------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -0.44 | 0.13 | -0.31 |
| 其中：基金申购款 | -0.66 | 0.21 | -0.45 |
| 基金赎回款 | 0.22 | -0.08 | 0.14 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -5.65 | 1.90 | -3.75 |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年 12月31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 40,499.41 | 394,394.00 |
| 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 | 1,170.56 | 5,635.39 |
| 其他 | 272.82 | 307.74 |
| 合计 | 41,942.79 | 400,337.13 |

注：其他为交易保证金利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年 12月31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日 |
|------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 77,232,140.95 | 44,031,422.32 |
| 减：卖出股票成本总额 | 83,881,540.59 | 43,557,930.22 |
| 减：交易费用 | 197,453.84 | - |
| 买卖股票差价收入 | -6,846,853.48 | 473,492.10 |

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年 12月31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日 |
|--------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 2,833,503.37 | - |
| 债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入 | 51,088.52 | -297,914,277.03 |
| 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 | 2,884,591.89 | -297,914,277.03 |

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年12月 31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日 |
|---------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额 | 280,150,488.50 | 3,199,986,699.05 |
| 减: 卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额 | 274,017,920.01 | 3,442,678,821.84 |
| 减: 应计利息总额 | 6,079,046.11 | 55,222,154.24 |
| 减: 交易费用 | 2,433.86 | - |
| 买卖债券差价收入 | 51,088.52 | -297,914,277.03 |

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具产生的收益/损失。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022 年12月31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日 |
|---------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 333,820.01 | 16,701.92 |
| 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 | 333,820.01 | 16,701.92 |

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年01月01日至2022年12 月31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日 |
|--------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -461,846.97 | 248,318,150.88 |
| ——股票投资 | -7,966.97 | -623,751.99 |
| ——债券投资 | -453,880.00 | 248,941,902.87 |
| ——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 | -461,846.97 | 248,318,150.88 |

7.4.7.15 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年01月01日至2022年 12月31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日 |
|---------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 审计费用 | 60,000.00 | 90,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 汇划手续费 | 1,771.39 | 17,254.28 |
| 账户维护费 | 34,050.00 | 34,000.00 |
| 查询费 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 交易费用 | - | 165,432.13 |
| 合计 | 217,021.39 | 427,886.41 |

7.4.7.18 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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 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 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 2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 601,888.50 | 4,704,116.37 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 0.00 | 0.00 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.40%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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 | 上年度可比期间 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
| | 2022年01月01日至2022年12月31日 | 2021年01月01日至2021年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 75,236.01 | 588,014.49 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.05%的费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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 | | |
|----------------|-------------------------|---------|------|
| | 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 | | |
| | 富荣富乾债券A | 富荣富乾债券C | 合计 |
| 富荣基金管理有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 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 | | |
| | 富荣富乾债券A | 富荣富乾债券C | 合计 |
| 富荣基金管理有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

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0.01%。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**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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 2022年01月01日至2022年12月31日 | | 上年度可比期间 2021年01月01日至2021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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 12,479,522.16 | 40,499.41 | 5,616,630.52 | 394,394.00 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人上海浦发银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

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--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金于本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022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/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。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2022年12月31日,本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2021年12月31日:同)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 19,894,119.87 | 120,036,000.00 |
| 合计 | 19,894,119.87 | 120,036,000.00 |

注:1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

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式的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列式的同业存单。

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 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | - | - |
| AAA以下 | - | - |
| 未评级 | 92,188,972.60 | 20,028,000.00 |
| 合计 | 92,188,972.60 | 20,028,000.00 |

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。

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式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式的同业存单。

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 2022年1 2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 | 12,479,522.16 | - | - | - | 12,479,522.16 |
| 结算备付金 | 103,766.58 | - | - | - | 103,766.58 |
| 存出保证金 | 23,041.50 | - | - | - | 23,041.50 |
| 交易性金融资产 | 112,083,092.47 | - | - | 13,106,020.00 | 125,189,112.47 |
| 资产总计 | 124,689,422.71 | - | - | 13,106,020.00 | 137,795,442.71 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 46,648.53 | 46,648.53 |
| 应付托管费 | - | - | - | 5,831.06 | 5,831.06 |
| 其他负债 | - | - | - | 214,395.20 | 214,395.20 |
| 负债总计 | - | - | - | 266,874.79 | 266,874.79 |
| 利率敏感度缺口 | 124,689,422.71 | - | - | 不适用 | 不适用 |
| 上年度 末 2021年1 2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 | 5,616,630.52 | - | - | - | 5,616,630.52 |
| 存出保证金 | 28,104.44 | - | - | - | 28,104.44 |

| | | | | | |
|-----------|----------------|---|---|---------------|----------------|
| 交易性金融资产 | 140,064,000.00 | - | - | 29,791,795.00 | 169,855,795.00 |
| 买入返售金融资产 | 8,960,133.44 | - | - | - | 8,960,133.44 |
| 应收利息 | - | - | - | 3,271,700.07 | 3,271,700.07 |
| 资产总计 | 154,668,868.40 | - | - | 33,063,495.07 | 187,732,363.47 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 10,093,874.95 | - | - | - | 10,093,874.95 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 2,501,171.85 | 2,501,171.85 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 59,499.02 | 59,499.02 |
| 应付托管费 | - | - | - | 7,437.37 | 7,437.37 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 43,565.67 | 43,565.67 |
| 应付利息 | - | - | - | 1,275.73 | 1,275.73 |
| 其他负债 | - | - | - | 210,000.00 | 210,000.00 |
| 负债总计 | 10,093,874.95 | - | - | 2,822,949.64 | 12,916,824.59 |
| 利率敏感度缺口 | 144,574,993.45 | - | - | 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

| | | |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------|
| 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 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 利率上升25个基准点 | -140,404.51 | 0.00 |
| 利率下降25个基准点 | 140,829.22 | 0.00 |

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 2022年12月31日 | | 上年度末 2021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 | 13,106,020.00 | 9.53 | 29,791,795.00 | 17.04 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 112,083,092.47 | 81.50 | 140,064,000.00 | 80.12 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-------|----------------|-------|----------------|-------|
| 一权证投资 | | | | |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 125,189,112.47 | 91.03 | 169,855,795.00 | 97.16 |

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 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| | 基金业绩比较基准上升 5% | -990,628.16 | 8,181,874.83 |
| 基金业绩比较基准下降 5% | 990,628.16 | -8,181,874.83 | |

注：基金业绩比较基准 = 中债综合指数（总财富）收益率 × 90% + 1年期定期存款利率（税后） × 10%。

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 2022年12月31日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| 第一层次 | 13,106,020.00 | 29,791,795.00 |

| | | |
|------|----------------|----------------|
| 第二层次 | 112,083,092.47 | 140,064,000.00 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 125,189,112.47 | 169,855,795.00 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

本基金本报告期末及上年度末均不存在公允价值属于第三层次的金融工具。

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2023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 | 13,106,020.00 | 9.51 |
| | 其中：股票 | 13,106,020.00 | 9.51 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 112,083,092.47 | 81.34 |
| | 其中：债券 | 112,083,092.47 | 81.34 |
| | 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 | 12,583,288.74 | 9.13 |
| 8 | 其他各项资产 | 23,041.50 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 137,795,442.71 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 12,196,020.00 | 8.87 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 910,000.00 | 0.66 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|------|
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 13,106,020.00 | 9.53 |

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 | 3,000 | 5,181,000.00 | 3.77 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 10,000 | 1,806,900.00 | 1.31 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 50,000 | 1,550,000.00 | 1.13 |
| 4 | 000568 | 泸州老窖 | 5,000 | 1,121,400.00 | 0.82 |
| 5 | 000538 | 云南白药 | 20,000 | 1,087,200.00 | 0.79 |
| 6 | 000002 | 万科A | 50,000 | 910,000.00 | 0.66 |
| 7 | 600600 | 青岛啤酒 | 5,000 | 537,500.00 | 0.39 |
| 8 | 000895 | 双汇发展 | 20,000 | 518,600.00 | 0.38 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 1,000 | 393,420.00 | 0.29 |

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 | 300750 | 宁德时代 | 5,120,789.83 | 2.93 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 3,351,096.00 | 1.92 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 2,768,237.00 | 1.58 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 2,451,108.00 | 1.40 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,313,000.00 | 1.32 |
| 6 | 002179 | 中航光电 | 1,969,700.00 | 1.13 |
| 7 | 601888 | 中国中免 | 1,850,276.00 | 1.06 |
| 8 | 002176 | 江特电机 | 1,828,026.00 | 1.05 |
| 9 | 600585 | 海螺水泥 | 1,755,110.00 | 1.00 |
| 10 | 000538 | 云南白药 | 1,681,162.00 | 0.96 |
| 11 | 002756 | 永兴材料 | 1,667,260.00 | 0.95 |
| 12 | 601012 | 隆基绿能 | 1,653,525.20 | 0.95 |
| 13 | 601088 | 中国神华 | 1,634,000.00 | 0.93 |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 1,631,594.00 | 0.93 |
| 15 | 603678 | 火炬电子 | 1,479,049.00 | 0.85 |
| 16 | 600893 | 航发动力 | 1,459,800.00 | 0.84 |
| 17 | 600941 | 中国移动 | 1,383,127.00 | 0.79 |
| 18 | 600036 | 招商银行 | 1,382,691.00 | 0.79 |
| 19 | 300274 | 阳光电源 | 1,320,425.00 | 0.76 |
| 20 | 000001 | 平安银行 | 1,270,000.00 | 0.73 |

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 | 300750 | 宁德时代 | 6,121,583.00 | 3.50 |
| 2 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,660,488.04 | 2.09 |
| 3 | 601012 | 隆基绿能 | 3,077,021.00 | 1.76 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 3,043,720.00 | 1.74 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 5 | 600036 | 招商银行 | 2,766,183.00 | 1.58 |
| 6 | 603678 | 火炬电子 | 2,712,505.00 | 1.55 |
| 7 | 603259 | 药明康德 | 2,403,448.00 | 1.37 |
| 8 | 300059 | 东方财富 | 2,255,373.00 | 1.29 |
| 9 | 601318 | 中国平安 | 2,245,169.00 | 1.28 |
| 10 | 000792 | 盐湖股份 | 2,231,126.00 | 1.28 |
| 11 | 002594 | 比亚迪 | 2,011,092.00 | 1.15 |
| 12 | 002179 | 中航光电 | 1,831,533.00 | 1.05 |
| 13 | 000568 | 泸州老窖 | 1,802,385.00 | 1.03 |
| 14 | 002176 | 江特电机 | 1,743,994.00 | 1.00 |
| 15 | 601888 | 中国中免 | 1,737,111.00 | 0.99 |
| 16 | 601636 | 旗滨集团 | 1,620,964.00 | 0.93 |
| 17 | 002756 | 永兴材料 | 1,548,185.00 | 0.89 |
| 18 | 601088 | 中国神华 | 1,444,701.00 | 0.83 |
| 19 | 600585 | 海螺水泥 | 1,425,690.00 | 0.82 |
| 20 | 600941 | 中国移动 | 1,416,000.00 | 0.81 |

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 | 67,203,732.56 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 77,232,140.95 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 9,691,991.10 | 7.05 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 102,391,101.37 | 74.45 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| | 其中：政策性金融债 | 102,391,101.37 | 74.45 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 112,083,092.47 | 81.50 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 180211 | 18国开11 | 900,000 | 92,188,972.60 | 67.03 |
| 2 | 220201 | 22国开01 | 100,000 | 10,202,128.77 | 7.42 |
| 3 | 019666 | 22国债01 | 95,000 | 9,691,991.10 | 7.05 |

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，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。云南白药集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

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 | 23,041.50 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 23,041.50 |

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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---------|----------|------------|----------------|----------|--------|----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 富荣富乾债券A | 192 | 780,115.82 | 149,781,781.04 | 99.9997% | 457.05 | 0.0003% |
| 富荣富乾债券C | 23 | 1.11 | 3.39 | 13.3255% | 22.05 | 86.6745% |
| 合计 | 201 | 745,185.39 | 149,781,784.43 | 99.9997% | 479.10 | 0.0003% |

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 | 富荣富乾债券A | 9.36 | 0.00% |
| | 富荣富乾债券C | 1.05 | 4.13% |
| | 合计 | 10.41 | 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显示为0是由于保留位数问题导致的。

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 | 富荣富乾债券A | 0 |
| | 富荣富乾债券C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 富荣富乾债券A | 0 |
| | 富荣富乾债券C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 富荣富乾债券A | 富荣富乾债券C |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2018年02月07日)基金份额总额 | 1,542.39 | 202,000,036.04 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 184,352,249.15 | 23.14 |
| 本报告期基金总申购份额 | 4.30 | 3.45 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 34,570,015.36 | 1.15 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 149,782,238.09 | 25.44 |

§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：总经理、首席信息官高峰于2022年8月15日离任，董事长杨小舟代行总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案。

经上海浦东发展银行股份有限公司决定，总行资产托管部原总经理孔建同志自2022年11月7日起不再担任资产托管部总经理职务，由李国光同志担任部门负责人。

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件一起，对管理人及基金运作无重大影响。

报告期内，不涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金已改聘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5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- | 内容 |
|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|
| 受到稽查或处罚等措施的主体 | 管理人 |
| 受到稽查或处罚等措施的时间 | 2022-03-22 |
| 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 | 责令整改 |
| 受到稽查或处罚等措施的原因 | 从业人员资质管理不到位等 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 截止报告期末，管理人已采取整改措施，严格依据法律法规要求督促现有员工尽快通过基金从业资格考试并加强对新员工聘用资质的要求等。管理人已向监管部门提交整改报告，待监管部门验收通过。 |
| 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

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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 | 交 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备 |
|----|---|------|-----------|---|
| | | | | |

| 名称 | 易单元数量 | 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 | 注 |
|------|-------|----------------|--------------|------------|------------|---|
| 华创证券 | 2 | 144,435,873.51 | 100.00% | 108,513.50 | 100.00% | - |

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 |
| 华创证券 | 13,550,117.41 | 100.00% | - | - | - | - | - | - |

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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-01 |
| 2 | 富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年第4季度报告提示性公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-24 |
| 3 | 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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-24 |
| 4 | 富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年年度报告提 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网 | 2022-03-31 |

| | | | |
|----|--------------------------------------------------------------|----------------------------|------------|
| | 示性公告 | 站 | |
| 5 | 富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年第1季度报告提示性公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-22 |
| 6 | 富荣基金管理有限公司关于旗下基金参加北京创金启富基金销售有限公司基金认购、申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-25 |
| 7 | 富荣基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯信息科技有限公司基金认购、申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-25 |
| 8 | 富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-25 |
| 9 | 富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增和讯信息科技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的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-25 |
| 10 | 富荣基金管理有限公司关于基金经理结束产假恢复履行职务的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-27 |
| 11 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-29 |
| 12 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网 | 2022-04-29 |

| | | | |
|----|--------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|------------|
| | 股份有限公司基金认购、申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 站 | |
| 13 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中山证券有限责任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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-29 |
| 14 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中山证券有限责任公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-29 |
| 15 | 富荣基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-29 |
| 16 | 富荣基金管理有限公司关于开展旗下基金转换费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-30 |
| 17 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-16 |
| 18 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-17 |

| | | | |
|----|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|------------|
| | 率优惠活动的公告 | | |
| 19 | 富荣基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-21 |
| 20 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-06-23 |
| 21 | 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、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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-15 |
| 22 | 富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年第2季度报告提示性公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-21 |
| 23 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-22 |
| 24 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务并参加申购及定期定额投资申购费率优惠活动的 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-29 |

| | | | |
|----|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|------------|
| | 公告 | | |
| 25 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-08-01 |
| 26 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-08-10 |
| 27 | 富荣基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-08-16 |
| 28 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增粤开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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-08-22 |
| 29 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-08-29 |
| 30 | 富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年中期报告提 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网 | 2022-08-31 |

| | | | |
|----|----------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|------------|
| | 示性公告 | 站 | |
| 31 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-09-15 |
| 32 | 富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-09-20 |
| 33 | 富荣基金管理有限公司旗下全部基金2022年第3季度报告提示性公告 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-10-26 |
| 34 | 富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增九州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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-10-26 |
| 35 | 富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增海通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 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-24 |
| 36 | 富荣基金管理有限公司关于旗下基金新增华金证券股份 | 证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网 | 2022-12-12 |

| | | | |
|--|------------------------------------------------------|---|--|
| | 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 | 站 | |
|--|------------------------------------------------------|---|--|

§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 | 20220101 - 20221231 | 184,351,777.80 | 0.00 | 34,570,000.00 | 149,781,777.80 | 100.00% |

产品特有风险

本报告期本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情况，未来或存在如下风险，敬请投资者留意：
 （1）赎回申请延期办理的风险持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。（2）基金资产净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。（3）提前终止基金合同的风险 多名高比例投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，根据本合同约定，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人将向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，还将召开基金份额持有人大会进行表决。（4）基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，基金投资可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

注：①报告期间单一投资者持有基金份额占基金总份额比例显示为100%是由于保留位数问题导致的。

②申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人公告：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。上述人事变动已按相关规定备案。

§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富乾债券型证券投资基金设立的文件；
- 13.1.2 《富荣富乾债券型证券投资基金基金合同》；
- 13.1.3 《富荣富乾债券型证券投资基金托管协议》；
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

13.1.5 报告期内富荣富乾债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

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

富荣基金管理有限公司
二〇二三年三月三十一日