富荣富祥纯债债券型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 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 08 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。本中期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8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年06月30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 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
7.3 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 45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
7.6 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 46
7.7 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 46
7.8 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 47
7.9 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 47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 47
7.12 投资组合报告附注 47
§8 基金份额持有人信息 48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
8.3 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 49
§9 开放式基金份额变动 49
§10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 49
10.2 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 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 50
10.8 其他重大事件 50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 53
11.1 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 53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 54
§12 备查文件目录 54
12.1 备查文件目录 54
12.2 存放地点 54
12.3 查阅方式 54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富荣富祥纯债债券型证券投资基金
基金简称	富荣富祥纯债
基金主代码	003999
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年03月09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	257,343,645.93份
基金合同存续期	不定期

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	本基金通过宏观周期研究、行业周期研究、公司研究相结合，通过定量分析增强组合策略操作的方法，确定资产在基础配置、行业配置、公司配置结构上的比例。本基金充分发挥基金管理人长期积累的行业、公司研究成果，利用自主开发的信用分析系统，深入挖掘价值被低估的标的券种，以尽量获取最大化的信用溢价。本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、行业配置策略、息差策略、个券挖掘策略等。
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，属于中低预期风险/预期收益的产品。

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	中国光大银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	任晓伟	石立平
	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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.furamc.com.cn/
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2022年01月01日- 2022年06月30日）

本期已实现收益	8,673,691.62
本期利润	8,284,195.12
加权平均基金份额本期利润	0.0329
本期加权平均净值利润率	2.65%
本期基金份额净值增长率	2.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2022年06月30日）
期末可供分配利润	60,930,403.95
期末可供分配基金份额利润	0.2368
期末基金资产净值	324,829,324.80
期末基金份额净值	1.2622
3.1.3 累计期末指标	报告期末 （2022年06月30日）
基金份额累计净值增长率	29.12%

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

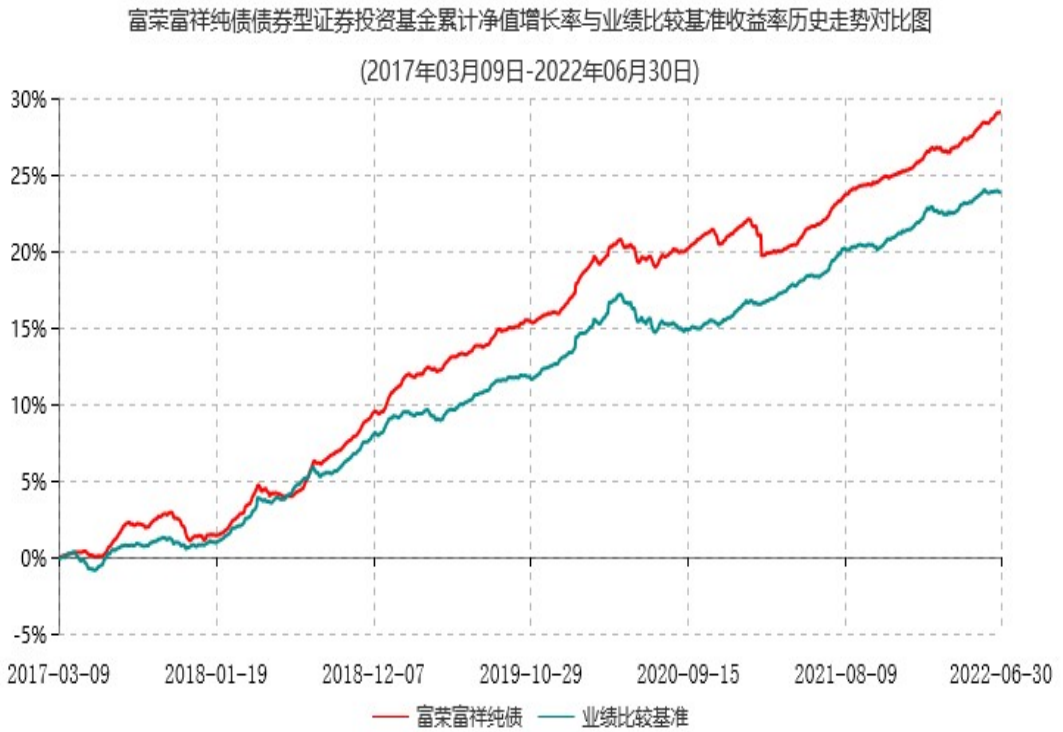
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.59%	0.03%	0.01%	0.02%	0.58%	0.01%
过去三个月	1.80%	0.03%	0.98%	0.03%	0.82%	0.00%
过去六个月	2.71%	0.05%	1.72%	0.05%	0.99%	0.00%
过去一年	5.77%	0.04%	4.44%	0.05%	1.33%	-0.01%
过去三年	13.78%	0.07%	12.32%	0.06%	1.46%	0.01%

自基金合同生效起至今	29.12%	0.07%	23.90%	0.06%	5.22%	0.01%

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



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。

§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		
吕晓蓉	固定收益部总经理、基金经理	2017-07-07	2022-03-21	11	清华大学工商管理硕士，中国人民大学经济学学士，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任普华永道中天会计师事务所审计师、嘉实基金管理有限公司组合头寸管理、新股、信用债、转债研究员。2017年6月12日加入富荣基金。
唐奥	基金经理	2022-03-04	-	5.5	中央财经大学经济学士，英国利兹大学经济金融硕士，持有基金从业资格证书，中国国籍。曾任华泰证券股份有限公司煤炭行业研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司信用研究员，中信建投证券股份有限公司信用研究员。2021年6月4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遵规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

2022年上半年，国内经济因疫情影响，4月、5月经济出现了较大波动，社零出现负增长，就业压力凸显，工业产值以及固定资产投资都有着较大回落，在中央及时出台政策后，国内经济环比有所回升，但是仍未恢复至潜在增长率。

利率债方面，长端利率呈震荡市。在年初的流动性宽松后，3月债市因为流动性的边际收紧以及经济数据的复苏有所上行，4月之后因国内疫情的超预期发酵，市场流动性再度转为宽松，利率转而下行，之后因市场对于长期货币政策看法的分歧，长端利率从5月震荡至今，10年国债在2.7%至2.85%之间反复震荡。

信用债方面，上半年信用债出现资产荒现象。信用债市场短券交易一度拥挤，主要原因为信贷需求不足，今年1-5月新增居民中长期贷款同比少增1.8万亿元，新增企业中长期贷款同比少增1.0万亿元，以致大部分资金转而投向债券市场。与此相对的，长端配置力量不足，长端债券利差仍处于较高水平。

总体来看，上半年债市一波三折，疫情对于债市影响极大，疫情之下，央行及时的释放了一定的流动性，但是对于降息仍然较为谨慎，意图保留一定的政策空间，也因此，债市走势相对纠结，因短期回购资金价格走低，因此短端资产利差收窄较多，但是长端

资产来看，利差仍然较大，大部分机构仍然担心疫情之后央行会收紧流动性，因此对于长端做多热情不足。

本基金以信用债投资为主，上半年组合继续保持了哑铃型的久期形态，上半年替换部分到期的短期债券，长期债券则以交易性持有为主，对于部分行业涌现出来的机会适当进行建仓。未来，本基金将继续本着稳健投资的原则，灵活把握交易窗口，为投资者争取最大化的长期回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富荣富祥纯债基金份额净值为1.2622元，本报告期内，基金份额净值增长率为2.71%，同期业绩比较基准收益率为1.72%。

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2022年下半年，目前国内正处于迈向高收入国家的关键阶段，过去经济所依赖的地产、基建、初级加工业等传统经济动能正在逐步减弱，而新经济仍处于蓬勃发展时期，尚无法全面补上传统经济的缺口。因此，在未来几年，传统经济与新经济之间的新老替换将是国内经济面临的第一大挑战。展望下半年，预计基建仍将部分发力以补上部分地产、初级工业下滑而带来的经济缺口，但是在目前这个时间段，基建并非万能，中央也仅是提出基建适度超前，注定了基建不可能再像以前一样全面发力，预计基建将更多的发力在新基建方向。地产市场预计将环比企稳，但是考虑到国内的人口结构、城市化进程、人均住房存量等多方面因素，地产市场很难回到去年同期水平，预计对于经济仍有一定拖累。疫情防控方面，随着下半年秋冬季节的到来以及海外大量人口感染导致的新变种，预计下半年疫情防控仍有一定压力，虽然在中央持续更新的防控方案下，很难再现大面积爆发，但是多点散发仍然是最可能的现实，因此预计下半年疫情仍然具有一定的反复性。

总体来看，目前国内经济正处于关键的转型时期，新经济蓬勃发展，但是总量上占比仍然较小，尽管增速较快，但是仍无法完全弥补旧经济下滑的缺口，同时疫情仍然面临着一定的反复风险，国内经济仍面临着较大的不确定性，在这种关键时刻，预计下半年央行的货币政策仍将“以我为主”，国内流动性预计将维持合理充裕，并无大幅度收紧的风险，同时考虑到通胀、汇率等多种政策目标，央行也将继续珍惜降息空间，在降息上预计将相对保守，多种因素叠加下，预计利率债市场仍将震荡为主，上下空间都有限。信用债市场仍有较多机会，目前国内仍有较多优质企业的长端债券仍有一定利差，如银行资本债、央企永续债、部分省属产业债等，在流动性的持续宽松下，预计部分优质长端信用债利差有一定收敛空间。

在债市操作上，预计信用票息策略仍为占优策略，在择券上，在目前新旧动能转换的关键阶段，过度下沉城投、民企等策略预计将面临着较大的波动风险，适度拉长优质企业债券久期获取一定的骑乘收益预计将有较大的胜率以及回报率。

4.6 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。

4.7 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；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6月30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。

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期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《富荣富祥纯债债券型证券投资基金2022年中期报告》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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富荣富祥纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	5,888,776.08	156,332.65
结算备付金		130,597.09	1,244,208.23
存出保证金		1,994.35	4,112.05
交易性金融资产	6.4.7.2	377,326,777.46	399,718,986.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		367,143,941.84	399,718,986.50
资产支持证券投资		10,182,835.62	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,000,943.68	-
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		-	2,184,210.57
应收股利		-	-
应收申购款		837,938.16	21,054.17
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	7,664,410.53
资产总计		386,187,026.82	410,993,314.70
负债和净资产	**附注号**	本期末 2022年06月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		61,051,548.84	89,981,323.51
应付清算款		-	1,000,406.31
应付赎回款		930.71	115.00
应付管理人报酬		77,070.71	80,372.82
应付托管费		25,690.24	26,790.96
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		38,410.44	46,742.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	164,051.08	214,943.95
负债合计		61,357,702.02	91,350,695.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	257,343,645.93	260,096,668.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	67,485,678.87	59,545,950.82
净资产合计		324,829,324.80	319,642,619.63
负债和净资产总计		386,187,026.82	410,993,314.70

注：（1）报告截止日2022年06月30日，基金份额净值人民币1.2622元，基金份额总额257,343,645.93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。

6.2 利润表

会计主体：富荣富祥纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		9,716,158.04	2,251,493.68
1.利息收入		35,482.85	10,590,977.89
其中：存款利息收入	6.4.7.8	17,774.85	40,567.13
债券利息收入		-	10,369,940.49
资产支持证券利息收入		-	174,995.50
买入返售金融资产收入		17,708.00	5,474.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,064,926.43	-7,899,699.08
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	9,739,960.79	-7,862,040.05
资产支持证券投资收益	6.4.7.11	324,965.64	-37,659.03
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
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）	6.4.7.14	-389,496.50	-455,766.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.15	5,245.26	15,981.36

号填列）			
减：二、营业总支出		1,431,962.92	1,681,057.71
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	465,683.03	470,448.88
2．托管费	6.4.10.2.2	155,227.65	156,816.27
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		674,286.45	891,642.57
其中：卖出回购金融资产支出		674,286.45	891,642.57
6．信用减值损失		-	-
7．税金及附加		24,636.14	36,729.35
8．其他费用	6.4.7.16	112,129.65	125,420.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,284,195.12	570,435.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,284,195.12	570,435.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,284,195.12	570,435.97

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。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：富荣富祥纯债债券型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期

	2022年01月01日至2022年06月30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）	260,096,668.81	-	59,545,950.82	319,642,619.63
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）	260,096,668.81	-	59,545,950.82	319,642,619.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,753,022.88	-	7,939,728.05	5,186,705.17
（一）、综合收益总额	-	-	8,284,195.12	8,284,195.12
（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）	-2,753,022.88	-	-344,467.07	-3,097,489.95
其中：1.基金申购款	16,146,949.32	-	4,132,475.79	20,279,425.11
2.基金赎回款	-18,899,972.20	-	-4,476,942.86	-23,376,915.06
（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）	257,343,645.93	-	67,485,678.87	324,829,324.80
项 目	上年度可比期间			

	2021年01月01日至2021年06月30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）	335,586,152.62	-	63,278,541.63	398,864,694.25
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）	335,586,152.62	-	63,278,541.63	398,864,694.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-64,366,490.57	-	-10,852,203.78	-75,218,694.35
（一）、综合收益总额	-	-	570,435.97	570,435.97
（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）	-64,366,490.57	-	-11,422,639.75	-75,789,130.32
其中：1.基金申购款	141,819,251.12	-	26,325,351.49	168,144,602.61
2.基金赎回款	-206,185,741.69	-	-37,747,991.24	-243,933,732.93
（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）	271,219,662.05	-	52,426,337.85	323,645,999.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富荣富祥纯债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[2016]2331号文《关于准予富荣富祥纯债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募集，基金合同于2017年3月9日正式生效，首次设立募集规模为200,019,971.80份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金管理人为富荣基金管理有限公司，登记机构为富荣基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称"中国光大银行")。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、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）。

本基金不投资于股票或权证，也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％；本基金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。

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%。

6.4.2 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3号《半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。

6.4.3 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6月30日及2021年12月31日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年6月30日和2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 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

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

（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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

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。

于首次执行日，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156,332.65元，自应收利息转入的重分类金额为人民币710.31元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0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157,042.96元。

结算备付金于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1,244,208.23元，自应收利息转入的重分类金额为人民币615.89元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于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1,244,824.12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4,112.05元，自应收利息转入的重分类金额为人民币2.09元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0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4,114.14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7,664,410.53元，转出至银行存款的重分类金额为人民币710.31元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币615.89元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币2.09元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币7,663,082.24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399,718,986.50元，自应收利息转入的重分类金额为人民币7,663,082.24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407,382,068.74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89,981,323.51元，自应付利息转入的重分类金额为人民币2,549.30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89,983,872.81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2,549.30元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币2,549.30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及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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）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。

（2）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。

（3）企业所得税

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

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

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	5,888,776.08
等于：本金	5,888,299.54
加：应计利息	476.54
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,888,776.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	49,318,316.17	1,042,033.38	50,885,220.78	524,871.23
	银行间市场	310,428,659.63	5,956,821.06	316,258,721.06	-126,759.63
	合计	359,746,975.80	6,998,854.44	367,143,941.84	398,111.60
资产支持证券		10,048,315.07	171,835.62	10,182,835.62	-37,315.07
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		369,795,290.87	7,170,690.06	377,326,777.46	360,796.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,000,943.68	-
合计	2,000,943.68	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.38
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,790.55
其中：交易所市场	-
银行间市场	14,790.55
应付利息	-
预提费用	149,260.15
合计	164,051.08

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	260,096,668.81	260,096,668.81
本期申购	16,146,949.32	16,146,949.32
本期赎回（以“-”号填列）	-18,899,972.20	-18,899,972.20
本期末	257,343,645.93	257,343,645.93

注：申购包含基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	52,584,516.12	6,961,434.70	59,545,950.82
本期利润	8,673,691.62	-389,496.50	8,284,195.12
本期基金份额交易产生的变动数	-327,803.79	-16,663.28	-344,467.07
其中：基金申购款	3,723,778.78	408,697.01	4,132,475.79
基金赎回款	-4,051,582.57	-425,360.29	-4,476,942.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,930,403.95	6,555,274.92	67,485,678.87

6.4.7.8 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06月30日
活期存款利息收入	6,689.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,057.23
其他	28.42
合计	17,774.85

注：其他为交易保证金利息收入。

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金于本报告期无股票投资收益。

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 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06月30日
债券投资收益——利息收入	8,276,981.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,462,979.71
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	9,739,960.79

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	282,063,634.86
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	274,645,046.72
减：应计利息总额	5,948,876.17
减：交易费用	6,732.26
买卖债券差价收入	1,462,979.71

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

6.4.7.11.1 资产支持证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06月30日

资产支持证券投资收益——利息收入	193,110.49
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	131,855.15
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	324,965.64

6.4.7.11.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	10,344,284.93
减：卖出资产支持证券成本总额	9,867,972.60
减：应计利息总额	344,284.93
减：交易费用	172.25
资产支持证券投资收益	131,855.15

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.14 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06月30日
1.交易性金融资产	-389,496.50
——股票投资	-

——债券投资	-352,181.43
——资产支持证券投资	-37,315.07
——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	-389,496.50

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	5,245.26
合计	5,245.26

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期少于7日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产，大于等于7日的将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,189.50
帐户维护费	16,080.00
查询费	600.00
合计	112,129.65

6.4.7.17 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	465,683.03	470,448.88
其中：支付销售机构的客户维护费	33,523.64	25,298.29

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0.30%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.30%/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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	155,227.65	156,816.27

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0.10%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%/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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	196,111.28	196,111.28
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	196,111.28	196,111.28
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.076%	0.072%

注：1、对于分类基金，比例的分母采用各自类别的总份额。

2、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

6.4.10.4.2 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

本基金于本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.10.5 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06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	5,888,299.54	6,689.20	627,716.16	5,914.55

注：本基金的活期银行存款由基金托管人光大银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 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。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金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61,051,548.84元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101800378	18津城建MTN009	2022-07-07	102.20	12,000	1,226,404.60
101800488	18银川通联MTN001	2022-07-04	99.92	100,000	9,991,991.78
102281192	22晋能煤业MTN009A	2022-07-04	100.25	100,000	10,024,863.01
102281203	22潞安MTN008	2022-07-07	99.84	166,000	16,573,545.51
160207	16国开07	2022-07-05	101.86	20,000	2,037,169.32
1680136	16浏阳经开债02	2022-07-05	20.43	100,000	2,042,549.70
1780254	17运城专项债	2022-07-05	62.82	160,000	10,050,430.25
1928013	19民生银行永续债	2022-07-05	102.49	100,000	10,248,701.37
2128016	21民生银行永续债01	2022-07-05	99.93	100,000	9,992,915.07
合计				858,000	72,188,570.61

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 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06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	10,523,095.89	-
A-1以下	-	-
未评级	10,322,575.34	58,097,800.00
合计	20,845,671.23	58,097,800.00

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。

3.债券投资以净价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	10,182,835.62	-
合计	10,182,835.62	-

注：1.资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.资产支持证券投资以净价列示。

3.短期信用评级A-1所填列的资产支持证券均为AAA级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 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06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	187,815,271.11	142,916,828.50
AAA以下	91,327,953.33	139,827,858.00
未评级	67,155,046.17	58,876,500.00
合计	346,298,270.61	341,621,186.50

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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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6.4.12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6.4.12.3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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,888,776.08	-	-	-	5,888,776.08
结算备付金	130,597.09	-	-	-	130,597.09
存出保证金	1,994.35	-	-	-	1,994.35
交易性金融资产	155,372,398.62	216,077,612.12	5,876,766.72	-	377,326,777.46
买入返售金融资产	2,000,943.68	-	-	-	2,000,943.68
应收申购款	-	-	-	837,938.16	837,938.16
资产总计	163,394,709.82	216,077,612.12	5,876,766.72	837,938.16	386,187,026.82
负债					
卖出回购金融资产款	61,051,548.84	-	-	-	61,051,548.84
应付赎回款	-	-	-	930.71	930.71
应付管理人报酬	-	-	-	77,070.71	77,070.71
应付托管费	-	-	-	25,690.24	25,690.24
应付交	-	-	-	14,790.55	14,790.55

易费用					
应交税费	-	-	-	38,410.44	38,410.44
其他负债	-	-	-	149,260.53	149,260.53
负债总计	61,051,548.84	-	-	306,153.18	61,357,702.02
利率敏感度缺口	102,343,160.98	216,077,612.12	5,876,766.72	不适用	不适用
上年度末 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	156,332.65	-	-	-	156,332.65
结算备付金	1,244,208.23	-	-	-	1,244,208.23
存出保证金	4,112.05	-	-	-	4,112.05
交易性金融资产	155,247,596.50	190,647,890.00	53,823,500.00	-	399,718,986.50
应收证券清算款	-	-	-	2,184,210.57	2,184,210.57
应收利息	-	-	-	7,664,410.53	7,664,410.53
应收申购款	-	-	-	21,054.17	21,054.17
资产总计	156,652,249.43	190,647,890.00	53,823,500.00	9,869,675.27	410,993,314.70
负债					
卖出回购金融资产款	89,981,323.51	-	-	-	89,981,323.51
应付证券清算款	-	-	-	1,000,406.31	1,000,406.31
应付赎回款	-	-	-	115.00	115.00
应付管理人报	-	-	-	80,372.82	80,372.82

酬					
应付托管费	-	-	-	26,790.96	26,790.96
应付交易费用	-	-	-	32,394.63	32,394.63
应交税费	-	-	-	46,742.52	46,742.52
应付利息	-	-	-	2,549.30	2,549.30
其他负债	-	-	-	180,000.02	180,000.02
负债总计	89,981,323.51	-	-	1,369,371.56	91,350,695.07
利率敏感度缺口	66,670,925.92	190,647,890.00	53,823,500.00	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。

6.4.13.4.1.2 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06月30日	上年度末 2021年12月31日
	利率上升25个基准点	-1,715,079.09	-2,049,391.11
	利率下降25个基准点	1,741,240.66	2,082,373.63

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30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	-	-	-	-
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	367,143,941.84	113.03	399,718,986.50	125.05
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	367,143,941.84	113.03	399,718,986.50	125.05

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2022年06月30日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	377,326,777.46	399,718,986.50
第三层次	-	-
合计	377,326,777.46	399,718,986.50

6.4.14.2.2 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，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于此期间将相关证券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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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．财务报表的批准

本财务报表已于2022年08月29日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	377,326,777.46	97.71
	其中：债券	367,143,941.84	95.07
	资产支持证券	10,182,835.62	2.64
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,000,943.68	0.52
	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	6,019,373.17	1.56
8	其他各项资产	839,932.51	0.22
9	合计	386,187,026.82	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 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。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 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	5,876,766.72	1.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	102,780,684.93	31.64
	其中：政策性金融债	20,371,693.15	6.27
4	企业债券	67,688,281.47	20.84
5	企业短期融资券	20,845,671.23	6.42
6	中期票据	169,952,537.49	52.32
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	367,143,941.84	113.03

7.6 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	092100008	21中国信达债01	200,000	21,155,276.71	6.51
2	2029001	20网商银行永续债01	200,000	20,854,246.58	6.42
3	160207	16国开07	200,000	20,371,693.15	6.27
4	2220007	22厦门国际银行永续债01	200,000	20,157,852.05	6.21
5	102281203	22潞安MTN008	200,000	19,968,127.12	6.15

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	193974	象屿YS3A	100,000	10,182,835.62	3.13

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、厦门国际银行股份有限公司、网商银行股份有限公司、民生银行股份有限公司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。

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。

7.12.2 本基金本报告期末未持有股票。

7.12.3 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	1,994.35

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	837,938.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	839,932.51

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,299	198,109.04	237,133,993.22	92.1468%	20,209,652.71	7.8532%

注：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。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	40.21	0.00%

注：占基金总份额比例展示为0，是由于保留位数导致。

8.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年03月09日)基金份额总额	200,019,971.80
本报告期期初基金份额总额	260,096,668.81
本报告期基金总申购份额	16,146,949.32
减：本报告期基金总赎回份额	18,899,972.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	257,343,645.93

注：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

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。

10.3 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。

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）未发生变更。

10.6 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，深圳证监局现场检查对管理人出具了行政监管措施，管理人已按要求进行整改。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
广发证券	2	-	-	-	-	-

（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。

10.7.2 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
广发证券	37,810,100.52	100.00%	1,324,800,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-01-24
3	富荣富祥纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报	2022-03-05
4	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	中国证券报、上海证券报、证券日报	2022-03-09
5	富荣富祥纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报	2022-03-23
6	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-03-24
7	富荣基金管理有限公司旗下全部基金2021年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-03-31
8	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-22
9	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-25
10	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-25

	构、开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告		
11	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-25
12	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-25
13	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
14	富荣基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
15	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
16	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29
17	富荣基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-29

	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		
18	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-04-30
19	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	中国证券报、证券时报、证券日报	2022-05-16
20	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	2022-05-17
21	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-06-21
22	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2022-06-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 - 20220630	81,879,145.17	0.00	0.00	81,879,145.17	31.82%
	2	20220316 - 20220630	51,790,659.37	0.00	0.00	51,790,659.37	20.13%
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，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内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：申购含转换入份额、红利再投资份额；赎回含转换出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准富荣富祥纯债债券型证券投资基金设立的文件；

12.1.2《富荣富祥纯债债券型证券投资基金基金合同》；

12.1.3《富荣富祥纯债债券型证券投资基金托管协议》；

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

12.1.5 报告期内富荣富祥纯债债券型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 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

二〇二二年八月三十一日