富荣富祥纯债债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年03月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月25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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	118,809,436.42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	滕大江	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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

§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	2018年	2017年3月9日(基金合同生效日)-2017年12月31日
本期已实现收益	5,945,502.50	6,412,250.57
本期利润	11,943,971.34	2,387,075.16
加权平均基金份额本期利润	0.0887	0.0119
本期基金份额净值增长率	8.41%	1.19%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末
期末可供分配基金份额利润	0.0491	0.0119
期末基金资产净值	127,409,961.52	202,390,409.92
期末基金份额净值	1.0724	1.0119

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。

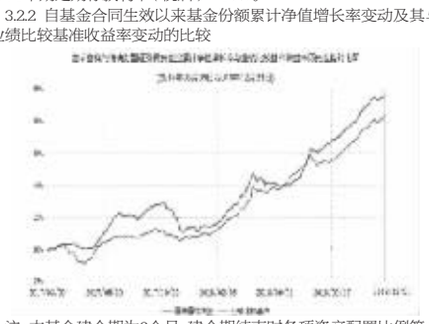
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	2.54%	0.04%	2.43%	0.04%	0.11%	0.00%
过去六个月	5.45%	0.05%	3.84%	0.05%	1.61%	0.00%
过去一年	8.41%	0.06%	7.53%	0.06%	0.88%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.70%	0.06%	8.45%	0.06%	1.25%	0.00%

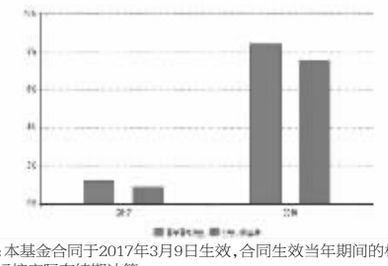
注:本基金的业绩比较基准为:中债综合指数(总财富)收益率×90%+1年期定期存款利率(税后)×10%。

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。

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2017年3月9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

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.230	4,600,034.18	24.61	4,600,058.79	-
合计	0.230	4,600,034.18	24.61	4,600,058.79	-

§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深圳证券交易所广场,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	基金经理	2017-07-07	-	7.5年	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。

注:1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,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,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况,基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

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。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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2018年,宏观基本面和货币、监管政策都经历了一番调整,债券牛市行情也并非一帆风顺。一季度中美贸易战打响前奏,开年资金宽松,利率债快速完成牛熊切换;二季度在经济下行压力、地方债务风险担忧的情绪中信用债流动性几近冻结;三季度各项高层会议纷纷表态着力疏通货币传导机制,资管新规落地,信用利差大幅压缩而利率债则震荡回调;四季度,一方面民企纾困政策频出,一方面经济下行压力进一步加大,长端利率债重新进入快步上涨轨道。全年来看,十年期国债收益率下行了65BP,十年期国开债收益率下行了117BP,三年AA+级别中票收益率下行了149BP。

报告期内本基金重点配置了中等偏高资质的信用债,并根据市场变化灵活调整杠杆和久期,取得了较好的绝对收益和相对收益。

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1.0724元,本报告期内,基金份额净值增长率为8.41%,同期业绩比较基准收益率为7.53%。

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2019年,全球经济下行压力仍然较大,贸易战谈判正在进行中,地缘政治冲突仍是加速经济周期下滑的变量之一;通胀方面关于滞胀的担忧会阶段性出现,但总需求增速减缓的情况下,通胀的压力总体可控;政策的对冲调节也逐渐可见,美联储加息缩表节奏预计将有所放缓,中国货币政策稳健中性但实质偏宽松,政策重心在于纾解货币传导机制,更多惠及实体经济。在此背景下,全球整体投资格局相对有利于无风险资产,风险资产仍将承压,国内股债等代表性资产价格亦趋同于大趋势,但由于2018年表现相对提前因此节奏上或略有不同。具体来看,利率债总体面临较为有利的宏观环境,预计处于牛市后半程,下行空间或有收窄,交易可关注波动中的机会。信用债方面,利率震荡走牛过程中,信用债收益率与利率走势基本趋同,企业盈利下滑与纾困政策同时作用下,相信违约情况仍会频出但会保持点状过程,系统性风险的底线仍会守住,但信用利差也处于相对低位,信用债配置需要着重考虑久期、资质和流动性的相对平衡,当前部分地区的公益性属性强的城投、优质地产债和民企龙头企业可提供一定的收益增强的机会。A股市场前期跌幅较大,低估值与盈利压力双向作用下正处于政策底向盈利底传导过程中,阶段性、结构性机会多见,可适时布局固收增强品种。

本基金将继续本着稳健投资的原则,以绝对收益为目标,灵活把握交易窗口,争取为投资者争取最大化的长期回报。

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,进一步完善了公司的内控体系;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,确保投各项业务的合规开展;建立入职合规宣导机制以及多次组织开展合规培训,不断提高从业人员的合规素质;开展对基金投资运作和公司经营管理的合规性稽核,通过实时监控、定期检查、专项检查等方式,检查业务开展的合规性和制度执行的有效性;严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料,督促落实销售适当性管理制度,并努力做好投资者教育工作;完成各项信息披露工作,保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金管理人承诺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,努力防范各种风险,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。

本基金本报告期共进行利润分配一次。2018年3月6日(权益登记日)分配利润4,600,058.79元,每10份基金份额分红0.23元。符合本基金合同约定。

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《富荣富祥纯债债券型证券投资基金2018年年度报告》进行了复核,认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2019)审字第61475609_H03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	富荣富祥纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了富荣富祥纯债债券型证券投资基金的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表,所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的富荣富祥纯债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,公允反映了富荣富祥纯债债券型证券投资基金2018年12月31日的财务状况以及2018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,我们独立于富荣富祥纯债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	富荣富祥纯债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祥纯债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祥纯债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,就可能导致对富荣富祥纯债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祥纯债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、结构和内容(包括披露),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,包括内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、高 鹤
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
审计报告日期	2019-03-28

§7 年度财务报表

7.1 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:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	148,850.60	548,431.45
结算备付金	1,425,262.66	-
存出保证金	4,651.94	-
交易性金融资产	168,709,794.00	268,567,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	168,709,794.00	268,567,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	910,079.97	-
应收利息	4,278,650.71	7,676,837.74
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	175,477,289.88	276,792,269.19
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	47,583,554.87	73,874,510.18
应付证券清算款	-	3,442.19
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	32,469.26	51,614.99
应付托管费	10,823.09	17,205.00
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,651.80	13,726.36
应交税费	20,918.39	-
应付利息	48,910.95	79,360.55
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,000.00	362,000.00
负债合计	48,067,328.36	74,401,859.27
所有者权益:		
实收基金	118,809,436.42	200,003,657.99
未分配利润	8,600,525.10	2,386,751.93
所有者权益合计	127,409,961.52	202,390,409.92
负债和所有者权益总计	175,477,289.88	276,792,269.19

注:1、报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0724元,基金份额总额118,809,436.42份;

2、上年度实际编制期间为2017年3月9日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

7.2 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:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	14,538,371.37	4,953,232.37
1.利息收入	8,964,006.11	8,920,172.63
其中:存款利息收入	123,204.59	116,604.59
债券利息收入	8,802,045.62	7,574,564.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	38,755.90	1,229,003.98
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-431,933.35	58,225.54
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-431,933.35	58,225.54
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	5,998,468.84	-4,025,175.41
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7,829.77	9.61
减:二、费用	2,594,400.03	2,566,157.21
1. 管理人报酬	419,037.50	494,874.55
2. 托管费	139,679.19	164,958.13
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,145.83	3,307.59
5. 利息支出	1,658,162.90	1,517,095.41
其中:卖出回购金融资产支出	1,658,162.90	1,517,095.41
6. 税金及附加	30,898.29	-
7. 其他费用	333,476.32	385,921.53
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	11,943,971.34	2,387,075.16
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	11,943,971.34	2,387,075.16

7.3 所有者权益(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:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,003,657.99	2,386,751.93	202,390,409.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,943,971.34	11,943,971.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-81,194,221.57	-1,130,139.38	-82,324,360.95
其中:1.基金申购款	149,630,857.54	2,804,752.57	152,435,610.11
2.基金赎回款	-230,825,079.11	-3,934,891.95	-234,759,971.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-4,600,058.79	-4,600,058.79
五、期末所有者权益(基金净值)	118,809,436.42	8,600,525.10	127,409,961.52
项 目	上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,019,971.80	-	200,019,971.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,387,075.16	2,387,075.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-16,313.81	-323.23	-16,637.04
其中:1.基金申购款	40.59	0.40	40.99
2.基金赎回款	-16,354.40	-323.63	-16,678.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	200,003,657.99	2,386,751.93	202,390,409.92

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:

郭容辰	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,注册登记机构为富荣基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称"中国光大银行")。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、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%。

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、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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

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。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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(简称"富荣基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行	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
深圳鹏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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.7.1.3 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。

7.4.7.1.4 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。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	419,037.50	494,874.55
其中:支付销售机构的客户维护费	394.34	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0.30%的年费率计提。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

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	139,679.19	164,958.13

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%的年费率计提。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

7.4.7.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金合同生效日(2017年03月09日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	196,111.28	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	196,111.28	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.17%	-

注:1、申购含转换入份额、红利再投资份额;赎回含转换出份额。

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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年03月09日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	148,850.60	18,238.61	548,431.45	91,171.89

注:本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.8 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,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30,083,554.87元,是以如下债