

财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 27 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现 .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
§4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
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 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 .....	13
§5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	14
§6 半年度财务会计报告(未经审计) .....	14
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
§7 投资组合报告 .....	41
7.1 期末基金资产组合情况 .....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	41
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 .....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	44
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	46
§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 期末上市基金前十名持有人 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.4 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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	49
§9 开放式基金份额变动 .....	50
§10 重大事件揭示 .....	50
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
§12 备查文件目录 .....	56
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	财通福盛定开混合发起
场内简称	财通福盛
基金主代码	501032
交易代码	501032
基金运作方式	上市契约型、定期开放。本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请。
基金合同生效日	2017年01月25日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	262,843,329.72份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017年4月21日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变

	<p>化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。</p> <p>本基金在价值投资理念的基础上，建立成长策略、主题策略、定向增发策略以及动量策略等多策略体系，并根据市场环境的变化进行针对性运用；固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益；在严格控制风险的前提下进行权证投资；根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。

### 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	财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武祎
	联系电话	021-20537888
	电子邮箱	service@ctfund.com
客户服务电话	400-820-9888	95588
传真	021-20537999	010-66105798
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市银城中路68号时代金	北京市西城区复兴门内大街5

	融中心41/43楼	5号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	夏理芬	陈四清

## 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》
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §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（2019年01月01日- 2019年06月30日）
本期已实现收益	-7,701,722.16
本期利润	10,239,364.97
加权平均基金份额本期利润	0.0390
本期加权平均净值利润率	5.04%
本期基金份额净值增长率	5.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配利润	-59,606,121.26
期末可供分配基金份额利润	-0.2268
期末基金资产净值	203,237,208.46
期末基金份额净值	0.7732

3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019年06月30日）
基金份额累计净值增长率	-22.68%

注：(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或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)期末可供分配利润为期末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（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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	0.51%	0.37%	3.17%	0.65%	-2.66%	-0.28%
过去三个月	-2.34%	0.57%	-0.16%	0.84%	-2.18%	-0.27%
过去六个月	5.30%	0.56%	15.53%	0.85%	-10.23%	-0.29%
过去一年	-6.32%	0.62%	7.81%	0.84%	-14.13%	-0.22%
自基金合同生效起至今	-22.68%	0.82%	12.48%	0.65%	-35.16%	0.17%

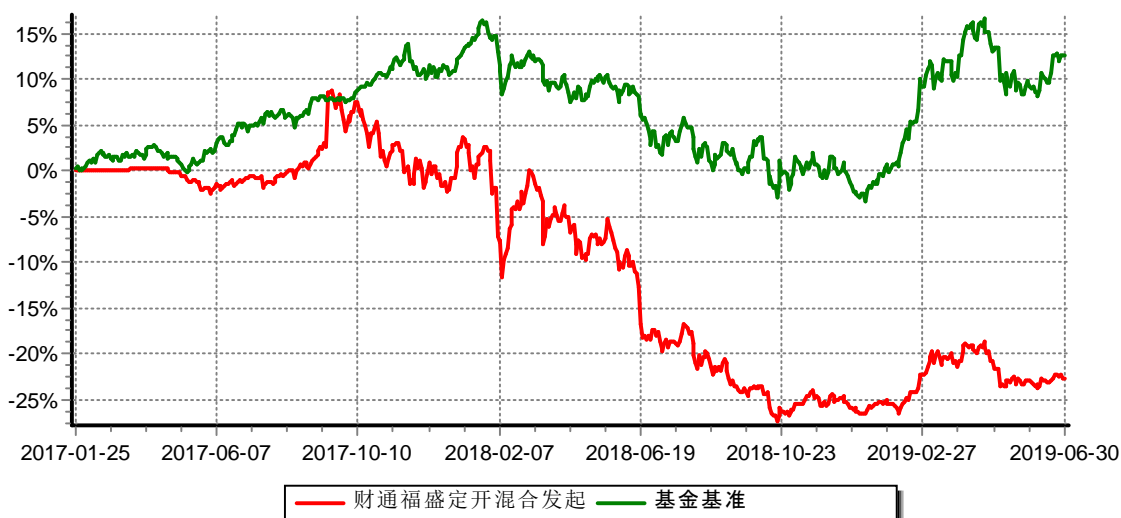
注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2017年1月25日-2019年6月30日）





注：(1)本基金合同生效日为2017年1月25日；

(2)根据《基金合同》规定：封闭期内，本基金投资于股票资产的比例为0~100%；开放期内，投资于股票资产的比例则为0~95%；非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于80%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金建仓期是2017年1月25日至2017年7月25日，截至建仓期末及报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求；

(3)本基金自2017年9月8日起根据中国证券投资基金业协会《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（中基协发〔2017〕6号）确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。

## §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

财通基金管理有限公司成立于2011年6月，由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江瀚叶股份有限公司共同发起设立，财通证券股份有限公司为第一大股东，出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币，注册地上海，经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承“持有人利益至上”的核心价值观，致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面，公司坚持以客户利益为出发点设计产品，逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一，形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌，产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点，为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

公司现有员工165人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在10年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

#### 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		
姚思劼	本基金的基金经理	2017年01月25日	-	7年	复旦大学理学学士、管理学硕士。2011年7月加入财通基金管理有限公司，历任财通基金管理有限公司助理研究员、研究员，研究行业覆盖汽车、机械、公用事业等，重点关注高端装备制造等战略新兴产业，现任基金投资部的基金经理。

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离任日期"为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)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)本基金自 2019 年 7 月 3 日增聘夏钦为基金经理，基金经理姚思劼于 2019 年 7 月 11 日因个人原因离职。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生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

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

报告期内，本基金参与上市公司定向增发项目，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《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易（短期国债回购交易除外）的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

## 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

二季度，我国经济增速相比一季度呈现稳中趋缓的态势，逐步修正由于一季度超预期的经济表现带来的乐观情绪，叠加5月新一轮中美贸易摩擦升级，对权益市场造成了较大的压力，市场整体的风险偏好出现明显回落。在内外环境均出现不确定性的背景下，以消费类行业龙头为代表的核心资产和贵金属板块在避险情绪的带动下获得了明显的超额收益。

本基金在二季度将仓位控制在偏低的水平，同时对持仓结构进行了一定的调整，在市场出现较大幅度回调后，在控制回撤风险的基础上寻求超额收益。展望今年的市场，我们认为市场已经基本走出了悲观预期的压制，外部环境对市场的边际影响趋弱，内部经济基本面虽然存在压力，但企业盈利的韧性叠加政策环境的呵护有利于市场的企稳回升，配置方面我们会重视以地产为代表的早周期行业，同时关注新科技与新消费领域的投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通福盛定开混合发起基金份额净值为0.7732元，本报告期内，基金份额净值增长率为5.30%，同期业绩比较基准收益率为15.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为从市场层面来看，经过了2018年的下跌，市场已经处于底部区域，无论从估值、风险偏好还是情绪指标等都到了历史低点，而政策方面已经开始了逐步宽松，外部的冲击也影响渐渐趋缓，我们相信未来市场将告别单边下跌。市场向好的核心因素包括估值、政策、流动性和风险偏好等都没有大的变化，而贸易摩擦虽然未来会长期化，但其产生的影响我们仍然认为从中期看，只是扰动因素，从二季度市场的表现基本就已经反映了这一点。

在我们看来，大风险都已经释放之后，目前投资应该着眼更为中长期，而决定中长期的则是经济转型的方向，目前政府的各种减税、转型政策已经走上了正确的道路上，未来中国的增长趋势将会更加高质，高效并且更加可持续，因此我们认为现在就是最好的播种期，相信不久的将来我们一定可以收获更多。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据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》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、基金投资部、专户投资部、固定收益部、研究部、风险管理部、监察稽核部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券

投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》。

本基金自2017年9月8日起根据中国证券投资基金业协会《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发〔2017〕6号）确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。基金管理人与中证指数有限公司签订了《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，委托中证指数有限公司计算并提供流通受限股票流动性折扣。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金行政外包协议》，与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》。截至报告期末，基金管理人对旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

在封闭期内，本基金不进行收益分配。

根据相关法律法规及《基金合同》的要求，结合本基金运作情况，本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 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

报告期内，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

## §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，本基金托管人在对财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——财通基金管理有限公司在财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对财通基金管理有限公司编制和披露的财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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：财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,141,923.96	145,823,030.57
结算备付金		-	-
存出保证金		11,788.89	73,048.72
交易性金融资产	6.4.7.2	189,235,130.53	47,634,680.11
其中：股票投资		48,177,130.53	47,634,680.11
基金投资		-	-
债券投资		141,058,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,227,763.75	29,197.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		203,616,607.13	193,559,956.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		249,398.69	249,282.04
应付托管费		41,566.44	41,547.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	13,291.20	1,284.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	75,142.34	270,000.00
负债合计		379,398.67	562,113.31
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	262,843,329.72	262,843,329.72
未分配利润	6.4.7.10	-59,606,121.26	-69,845,486.23
所有者权益合计		203,237,208.46	192,997,843.49

负债和所有者权益总计		203,616,607.13	193,559,956.80
------------	--	----------------	----------------

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

(2)报告截止日2019年6月30日，基金份额净值0.7732元，基金份额总额262,843,329.72份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日
<b>一、收入</b>		12,191,761.85	-81,490,910.11
1.利息收入		2,122,608.59	406,208.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	192,727.51	226,897.98
债券利息收入		1,928,633.52	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,247.56	179,310.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,871,933.87	-18,183,162.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,264,949.49	-21,186,328.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-240.00	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	393,255.62	3,003,166.51
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.16	17,941,087.13	-63,713,955.91



以“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		-	-
<b>减：二、费用</b>		1,952,396.88	4,821,593.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,508,982.66	3,618,182.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	251,497.14	603,030.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	73,940.19	447,890.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.18	117,976.89	152,489.32
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		10,239,364.97	-86,312,503.67
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		10,239,364.97	-86,312,503.67

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30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)	262,843,329.72	-69,845,486.23	192,997,843.49
二、本期经营活动产	-	10,239,364.97	10,239,364.97

生的基金净值变动数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	262,843,329.72	-59,606,121.26	203,237,208.46
项目	上年度可比期间		
	2018年01月01日至2018年06月30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)	517,211,063.05	-3,986,046.85	513,225,016.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-86,312,503.67	-86,312,503.67
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	517,211,063.05	-90,298,550.52	426,912,512.53

注：本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请。每个开放期时长为5至20个工作日，每个开放期的结束之日为上一个封闭期开始之日的18个月对日。即本基金任一个封闭期加上其后一个开放期构成的周期总时长原则上为18个月。本基金成立后三个月内开始在上海证券交易所上市交易。投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所交易基金份额。本基金已于2017年4月21日在上海证券交易所上市交易。

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：

王家俊

王家俊

刘为臻

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

财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")，系经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2016]2673号文《关于准予财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2017年1月25日正式生效，首次设立募集规模为517,211,063.05份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为财通基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：封闭期内，本基金投资于股票资产的比例为0~100%；开放期内，投资于股票资产的比例则为0~95%；非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于80%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现

金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

如因法律法规、市场环境变化或其他因素导致本基金无法参与上市公司定向增发项目的，本基金将履行相应程序，并更名为“财通福盛定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金”，基金的投资组合比例将不受上述“非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于80%”的限制，基金的投资目标、投资范围、运作方式等均保持不变。

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

#### 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（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。

#### 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2019年6月30日的财务状况以及自2019年1月1日起至2019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

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本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。对本基金在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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 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。

### 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 2019年06月30日
活期存款	11,141,923.96
定期存款	-

其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	11,141,923.96

注：本基金本报告期末未投资于定期存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	75,990,268.47	48,177,130.53	-27,813,137.94	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	141,850,480.00	141,058,000.00	-792,480.00
	合计	141,850,480.00	141,058,000.00	-792,480.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	217,840,748.47	189,235,130.53	-28,605,617.94	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	2,005.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	3,225,753.42
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.77
合计	3,227,763.75

注：其他项目为交易所结算保证金的应收利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	13,041.20
银行间市场应付交易费用	250.00
合计	13,291.20

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
----	--------------------



应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	75,142.34
合计	75,142.34

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	262,843,329.72	262,843,329.72
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	262,843,329.72	262,843,329.72

注：本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请。每个开放期时长为5至20个工作日，开放期的结束之日为上一个封闭期开始之日的18个月对日。即本基金任一个封闭期加上其后一个开放期构成的周期总时长原则上为18个月。本基金成立后三个月内开始在上海证券交易所上市交易。投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所交易基金份额。

#### 6.4.7.10 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
上年度末	-49,935,637.43	-19,909,848.80	-69,845,486.23
本期利润	-7,701,722.16	17,941,087.13	10,239,364.97
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-57,637,359.59	-1,968,761.67	-59,606,121.26

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	192,128.35
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	421.98
其他	177.18
合计	192,727.51

注：本基金本期其他存款利息收入为结算保证金利息收入177.18元。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	28,710,205.33
减：卖出股票成本总额	36,975,154.82
买卖股票差价收入	-8,264,949.49

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-240.00
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	-240.00

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
----	-------------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	30,000,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	29,851,740.00
减：应收利息总额	148,500.00
买卖债券差价收入	-240.00

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未投资资产支持证券，资产支持证券收益为零。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	393,255.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	393,255.62

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
1.交易性金融资产	17,941,087.13
——股票投资	18,733,567.13
——债券投资	-792,480.00

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	17,941,087.13

#### 6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	72,915.19
银行间市场交易费用	1,025.00
合计	73,940.19

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期未有其他收入。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	50,347.15
帐户维护费	18,000.00
其他费用	24,834.55
合计	117,976.89

#### 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2019年6月30日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，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

本基金本报告期不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。

##### 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
财通基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、基金销售机构
财通证券股份有限公司("财通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

注：下述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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未有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 2019年01月01日至201 9年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至201 8年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,508,982.66	3,618,182.92
其中：支付销售机构的客户维护费	497,153.75	1,338,611.57

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数；

(3)客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	251,497.14	603,030.55

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

### 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

本基金本报告期末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 2019年01月01日至2019年 06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06 月30日
----	-----------------------------------	--

基金合同生效日（2017年01月25日）持有的基金份额	10,000,350.00	10,000,350.00
报告期初持有的基金份额	10,000,350.00	10,000,350.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,350.00	10,000,350.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.8047%	1.9335%

注：(1)本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请；

(2)基金管理人运用固有资金10,000,000.00元作为发起资金认购本基金且承诺该部分基金份额持有期限不少于三年，募集期产生的利息为1,350元，以上合计为人民币10,000,350.00元，折合10,000,350.00份基金份额。基金管理人认购本基金适用的费率为固定认购费用1,000元。

#### 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

本基金本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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
中国工商银行活期存款	11,141,923.96	192,128.35	228,434,227.82	218,667.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000060	中金岭南	2017-07-03	2019-07-04	非公开发行限售	9.12	4.66	1,365,131	12,449,997.76	6,361,510.46	-
000060	中金岭南	2018-05-16	2019-07-04	非公开发行限售-转增	-	4.66	682,566	-	3,180,757.56	-
002276	万马股份	2017-07-10	2019-07-11	非公开发行限售	9.08	5.39	1,376,652	12,500,000.16	7,420,154.28	-
300075	数字政通	2017-08-18	2019-08-21	非公开发行限售	18.53	10.78	539,665	9,999,992.45	5,817,588.70	-
002431	棕榈股份	2017-07-07	2019-07-10	非公开发行	9.05	3.91	1,334,254	12,074,99	5,216,93	-



				行限售				8.70	3.14	
300310	宜通世纪	2017-07-10	2019-07-12	非公开发行限售	10.95	7.25	671,233	7,350,001.35	4,866,439.25	-
603889	新澳股份	2017-08-01	2019-07-29	非公开发行限售	13.01	6.70	411,222	5,349,998.22	2,755,187.40	-
603889	新澳股份	2019-06-12	2019-07-29	非公开发行限售-转增	-	6.70	123,367	-	826,558.90	-
000980	众泰汽车	2017-08-29	2019-08-30	非公开发行限售	9.63	4.02	794,392	7,649,994.96	3,193,455.84	-

注：(1)以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准；

(2)本基金持有的非公开发行股票中金岭南，于2018年5月16日实施2017年年度利润分配及资本公积金转增股本方案，以资本公积金向全体股东每10股转增5股，因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致；

(3)本基金持有的非公开发行股票新澳股份，于2019年6月12日实施2018年年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每10股转增3股，因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

#### 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

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 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

本基金是一只标准混合型证券投资基金，属于中高等级风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中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。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部和风险管理部，两者各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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建立了信用风险管理流程，通过对各类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。

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，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率计息，与该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、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。”

### 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

### 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。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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,141,923.96	-	-	-	-	-	11,141,923.96
存出保证金	11,788.89	-	-	-	-	-	11,788.89
交易性金融资产	-	-	141,058,000.00	-	-	48,177,130.53	189,235,130.53
应收利息	-	-	-	-	-	3,227,763.75	3,227,763.75
资产总计	11,153,712.85	-	141,058,000.00	-	-	51,404,894.28	203,616,607.13
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	249,398.69	249,398.69
应付托管费	-	-	-	-	-	41,566.44	41,566.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,291.20	13,291.20
其他负债	-	-	-	-	-	75,142.34	75,142.34
负债总计	-	-	-	-	-	379,398.67	379,398.67
利率敏感度缺口	11,153,712.85	-	141,058,000.00	-	-	51,025,495.61	203,237,208.46
上年度末2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	145,823,030.57	-	-	-	-	-	145,823,030.57
存出保证金	73,048.72	-	-	-	-	-	73,048.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	47,634,680.11	47,634,680.11
应收利息	-	-	-	-	-	29,197.40	29,197.40
资产总计	145,896,079.29	-	-	-	-	47,663,877.51	193,559,956.80
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	249,282.04	249,282.04
应付托管费	-	-	-	-	-	41,547.04	41,547.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,284.23	1,284.23
其他负债	-	-	-	-	-	270,000.00	270,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	562,113.31	562,113.31
利率敏感度缺口	145,896,079.29	-	-	-	-	47,101,764.20	192,997,843.49

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响，对其他会计科目的影响可忽略。		
假设	2.基金组合对利率的风险暴露，根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到，债券凸性对组合净值的影响可忽略。		
假设	3.市场即期利率曲线平行变动。		
假设	4.基金组合构成和其他市场变量保持不变。		
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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日

	市场利率下降25个基点	152,507.26	-
	市场利率上升25个基点	-152,507.26	-

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。封闭期内，本基金投资于股票资产的比例为0~100%；开放期内，投资于股票资产的比例则为0~95%；非公开发行股票资产占非现金资产的比例不低于80%。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2019年06月30日		上年度末 2018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	48,177,130.53	23.70	47,634,680.11	24.68

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	141,058,000.00	69.41	-	-
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	189,235,130.53	93.11	47,634,680.11	24.68

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	业绩比较基准增加1%	1,226,683.40	1,956,732.80
	业绩比较基准减少1%	-1,226,683.40	-1,956,732.80

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### 1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 2)以公允价值计量的金融工具

##### (1)各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币8,538,545.00元、属于第二层次的余额为人民币141,058,000.00元，属于第三层次的余额为人民币39,638,585.53元。

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币8,591,926.80元、属于第二层次的余额为人民币0元，属于第三层次的余额为人民币39,042,753.31元。

### (2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

### (3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

单位：人民币元

交易性金融资产

上年度末

39,042,753.31

转入第三层次

-

转出第三层次

7,769,772.18

当期计入损益的利得或损失总额

8,365,604.40

购买

-

出售

-

本期末

39,638,585.53

本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动

6,074,128.16

## 2、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。

## 3、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。

## §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	48,177,130.53	23.66
	其中：股票	48,177,130.53	23.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	141,058,000.00	69.28
	其中：债券	141,058,000.00	69.28
	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	11,141,923.96	5.47
8	其他各项资产	3,239,552.64	1.59
9	合计	203,616,607.13	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

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	26,166,531.44	12.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,476,423.14	2.69

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	10,684,027.95	5.26
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,309,854.00	2.12
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	1,540,294.00	0.76
S	综合	-	-
	合计	48,177,130.53	23.70

### 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通过港股通机制投资的港股。

### 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

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	000060	中金岭南	2,047,697	9,542,268.02	4.70
2	002276	万马股份	1,376,652	7,420,154.28	3.65
3	300075	数字政通	539,665	5,817,588.70	2.86
4	002431	棕榈股份	1,334,254	5,216,933.14	2.57
5	300310	宜通世纪	671,233	4,866,439.25	2.39
6	603889	新澳股份	534,589	3,581,746.30	1.76
7	000980	众泰汽车	794,392	3,193,455.84	1.57
8	600887	伊利股份	72,700	2,428,907.00	1.20

9	600340	华夏幸福	72,300	2,354,811.00	1.16
10	000002	万科A	70,300	1,955,043.00	0.96
11	002739	万达电影	45,800	844,552.00	0.42
12	000681	视觉中国	35,900	695,742.00	0.34
13	600284	浦东建设	33,700	259,490.00	0.13

## 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

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	600284	浦东建设	3,201,124.60	1.66
2	600663	陆家嘴	3,198,533.60	1.66
3	600887	伊利股份	2,125,740.91	1.10
4	600340	华夏幸福	2,095,045.00	1.09
5	000002	万科A	2,069,762.00	1.07
6	002739	万达电影	1,047,323.00	0.54
7	000681	视觉中国	1,044,114.00	0.54
8	600050	中国联通	1,034,545.00	0.54
9	002146	荣盛发展	1,006,295.00	0.52
10	000063	中兴通讯	983,488.00	0.51
11	300188	美亚柏科	978,067.00	0.51

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

### 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

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	601718	际华集团	6,516,787.10	3.38
2	600284	浦东建设	3,325,144.68	1.72
3	600663	陆家嘴	2,900,701.60	1.50
4	000717	韶钢松山	2,406,543.61	1.25

5	002044	美年健康	2,148,143.00	1.11
6	300146	汤臣倍健	2,126,308.00	1.10
7	300059	东方财富	1,602,005.00	0.83
8	002507	涪陵榨菜	1,563,006.24	0.81
9	000063	中兴通讯	1,398,202.00	0.72
10	300188	美亚柏科	1,131,026.00	0.59
11	002146	荣盛发展	1,092,258.00	0.57
12	600050	中国联通	1,003,516.00	0.52
13	002522	浙江众成	845,903.60	0.44
14	600986	科达股份	650,660.50	0.34

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	18,784,038.11
卖出股票收入（成交）总额	28,710,205.33

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”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。

#### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	141,058,000.00	69.41
	其中：政策性金融债	141,058,000.00	69.41
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	141,058,000.00	69.41
----	----	----------------	-------

## 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	040225	04国开25	500,000	50,735,000.00	24.96
2	140227	14国开27	500,000	50,295,000.00	24.75
3	180410	18农发10	400,000	40,028,000.00	19.70

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

本基金本报告期内未投资贵金属。

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

## 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

本基金暂不投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 报告期内，宜通世纪（证券代码：300310）于2018年7月12日收到广州市公安局天河区分局出具的《立案告知书》，案件情况存在不确定性，于2018年9月20日收到广东证监局下发的《关于对方炎林采取责令改正措施的决定》（[2018]66号）。除上述情况外，本基金投资的其他前九名证券的发行主体没有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。**

本基金投资宜通世纪（证券代码：300310）的投资决策程序为：

- 1、投资决策委员会根据有关法律规定并结合各基金合同的规定和风险控制对流通受限证券的各项投资比例限制，对各基金给予一定的授权；
- 2、本基金经理在拟定投资计划时，必须充分认识该项投资的流动性风险，并考虑所管理投资组合的投资风格和流动性特点，严格遵守基金合同以及风险控制制度对流通受限证券的各项投资比例限制；
- 3、研究部要对拟投资的流通受限证券提供详尽内部研究报告，必须有明确的投资建议；
- 4、金融工程小组须对拟投资的流通受限证券提供风险评估报告并报风险管理部备案；
- 5、基金经理根据基金合同、投资决策委员会对各基金经理的授权、投资组合的规模变化以及当时市场状况等对流通受限证券拟定投资计划；
- 6、公司旗下产品在投资流通受限证券过程中的风险比例必须严格按照风险控制的相关规定执行；
- 7、投资决策委员会对投资计划的批准：公司旗下产品参与公开发行股票网下配售部分的投资按照董事会批准的相关制度，由投资决策委员会负责相关投资决策；
- 8、基金经理根据授权下达指令；
- 9、监察稽核部和风险管理部按照职责要求，各自履行对投资于流通受限股票的事前、事中、事后的风险控制职能。

7.12.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	11,788.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,227,763.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,239,552.64

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000060	中金岭南	9,542,268.02	4.70	非公开发行解禁后受限
2	002276	万马股份	7,420,154.28	3.65	非公开发行解禁后受限
3	300075	数字政通	5,817,588.70	2.86	非公开发行解禁后受限
4	002431	棕榈股份	5,216,933.14	2.57	非公开发行解禁后受限

5	300310	宜通世纪	4,866,439.25	2.39	非公开发行解禁后受限
6	603889	新澳股份	3,581,746.30	1.76	非公开发行解禁后受限
7	000980	众泰汽车	3,193,455.84	1.57	非公开发行解禁后受限

注：根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》要求（下称《规定》），持有上市公司非公开发行股份的股东，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。上述通过非公开发行方式获得的股份已过限售期的，但根据《规定》要求需于一定时间内继续处于限售状态。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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
4,286	61,326.02	65,007,125.00	24.73%	197,836,204.72	75.27%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	杜娟	1,995,184.00	17.02
2	林楠楠	1,985,116.00	16.93
3	谢世祺	1,190,000.00	10.15
4	方东	987,576.00	8.42
5	董增	494,340.00	4.22
6	赵岩	391,642.00	3.34



7	岑姜兰	390,394.00	3.33
8	蒋建永	342,367.00	2.92
9	孙慧	267,200.00	2.28
10	曲丽	219,735.00	1.87

### 8.3 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	1,976.64	0.00%

### 8.4 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、基金投资和研发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

### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,350.00	3.80%	10,000,350.00	3.80%	自基金合同生效日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,350.00	3.80%	10,000,350.00	3.80%	自基金合同生效日起不少于3年

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年01月25日)基金份额总额	517,211,063.05
本报告期期初基金份额总额	262,843,329.72
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	262,843,329.72

注：本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请。每个开放期时长为5至20个工作日，开放期的结束之日为上一个封闭期开始之日的18个月对日。即本基金任一个封闭期加上其后一个开放期构成的周期总时长原则上为18个月。本基金成立后三个月内开始在上海证券交易所上市交易。投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所交易基金份额。

## §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

1、本报告期内，基金管理人于2019年1月18日聘任夏理芬先生担任公司董事长职务，原董事长刘未先生于2019年1月18日离任；

2、本报告期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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金转型，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 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	
新时代证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	8,268,298.00	17.41%	6,005.18	15.01%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	1,044,114.00	2.20%	742.64	1.86%	-
国泰君安	2	1,961,555.00	4.13%	1,395.29	3.49%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
中国中投证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	968,911.60	2.04%	708.54	1.77%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

国金证券	2	15,731,650.93	33.12%	14,360.51	35.90%	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	12,728,752.71	26.80%	11,854.40	29.64%	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	1,006,295.00	2.12%	715.79	1.79%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	3,935,246.60	8.29%	2,877.93	7.20%	-
方正证券	2	1,003,516.00	2.11%	733.92	1.83%	-
兴业证券	2	845,903.60	1.78%	601.69	1.50%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

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
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	10,500,000.00	50.24%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	10,400,000.00	49.76%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	《财通基金管理有限公司关于旗下基金2018年年度资产净值的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-02
2	《财通基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金调整信息披露媒体的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-17
3	《财通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-19
4	《财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年第4季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-19
5	《财通基金管理有限公司关于旗下证券投资基金投资资产支持证券的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-24
6	《长虹美菱股份有限公司简式权益变动报告书》	中国证监会指定报刊及网站	2019-02-14
7	《财通基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务	中国证监会指定报刊及网站	2019-02-15

	的公告》		
8	《财通基金管理有限公司关于旗下证券投资基金调整停牌股票估值方法的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-06
9	《财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（2019年第1号）》及其摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-08
10	《财通基金管理有限公司销售网点及销售人员资格信息一览表20181231》	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-08
11	《财通基金管理有限公司关于公司变更法定代表人并完成工商变更登记的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-16
12	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加弘业期货股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-20
13	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民商基金销售(上海)有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-21
14	《财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年年度报告》及其摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-29
15	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-30
16	《财通基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金持有“视觉中国”股票估值方法的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-13

17	《财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金2019年第一季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-22
18	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加长江期货股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-09
19	《关于上海农村商业银行股份有限公司暂停代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-07
20	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金拟参与科创板投资及相关风险揭示的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-20

## §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

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金托管协议；
- 4、财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点



上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心41楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>

财通基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十七日