财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）2020 年中期报告

2020 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:2020 年 08 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年8月28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。

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自2019年12月28日起转为上市契约型开放式（LOF）。基金名称变更为"财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）"。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020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 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 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 13
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 13
§5 托管人报告 13
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 14
§6 中期财务会计报告(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 18
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
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 44
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 44
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 45
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末上市基金前十名持有人 46

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 47
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 47
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 47
§9 开放式基金份额变动 48
§10 重大事件揭示 48
10.1 基金份额持有人大会决议 48
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 48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 48
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 49
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 49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 49
10.8 其他重大事件 51
§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 54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 55
§12 备查文件目录 55
12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）
基金简称	财通福盛混合发起（LOF）
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	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2019年12月28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	147,353,365.12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。 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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%
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。

注：本基金自 2019 年 12 月 28 日转型为上市开放式基金（LOF）。

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	郭明
	联系电话	021-20537888	010-66105799
	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@icbc.com.cn
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号时代金融中心41/43楼	北京市西城区复兴门内大街55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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ctfund.com
基金中期报告备置地点	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（2020年01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	-2,372,769.23
本期利润	27,504,043.52
加权平均基金份额本期利润	0.1641
本期加权平均净值利润率	20.97%
本期基金份额净值增长率	24.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	-51,239,033.66
期末可供分配基金份额利润	-0.3477
期末基金资产净值	140,373,250.88
期末基金份额净值	0.9526
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	24.43%

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	21.69%	1.25%	5.04%	0.62%	16.65%	0.63%
过去三个月	36.03%	1.54%	8.62%	0.63%	27.41%	0.91%
过去六个月	24.12%	1.90%	1.70%	1.05%	22.42%	0.85%
转型以来	24.43%	1.87%	3.03%	1.05%	21.40%	0.82%

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×70%＋上证国债指数收益率×30%。

3.2.2 自基金转型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：(1)本基金合同生效日为2017年1月25日，转型日期为2019年12月28日；

(2)本基金建仓期为自合同生效日起6个月，截至建仓期末和报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

§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169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		
夏钦	本基金的基金经理	2019年7月3日	-	12年	上海交通大学会计学硕士。历任上海申银万国证券研究所高级研究员、UBS(瑞银)董事、平安资产管理有限责任公司策略研究经理。2015年9月加入财通基金管理有限公司，现任基金投资部基金经理。

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"离职日期"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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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《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

2020年上半年是峰回路转的半年，市场热点也频繁切换，从一季度的半导体、计算机，到疫情期间的医药、消费，期间市场经历了新冠病毒的影响，经历了贸易战的升温，但是整体市场最终是以行业轮番上涨，轮番创新高的方式渡过，我们认为这个现象本身隐含了较大的信息，或意味着市场已经进入了新的上升周期。

在这轮周期中，我们认为市场参与者也出现了明显不同，这将使得市场结构性的差异将继续分化，二八现象还是会继续，新时代下，机构投资者的优势或将不断显现，主动管理型基金的投资方式将远远好于纯指数被动投资。

我们在前期的各个期间的财报中不断论述了投资理念和看好的方向，二季度坚守在这些领域的也获得了不错的成绩，我们坚信只要坚持对的方向，控制风险，就能走的更远。

在这一轮股市新周期中，我们认为把握市场主线，理解市场变化远比关注企业短期盈利、订单更为重要，好的商业模式，好的公司治理和好的行业未来会更加稀缺，也正是因为对于长期而非短期的关注，使得在一季度市场下跌的时候守住了这些优秀的公司，才有了二季度的收获，未来也将坚持我们的投资理念，坚定守住这些对的方向，通过企业的成长来实现净值的增长，为投资者创造不断价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通福盛混合发起（LOF）基金份额净值为0.9526元，本报告期内，基金份额净值增长率为24.12%，同期业绩比较基准收益率为1.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在现在的位置，大家都在猜测市场未来能走多久，我们认为由于本轮市场的走强与历次市场走强的因素都不一样，因此，本轮市场可能持续的时间可能也会更长，不会很快出现牛短熊长的局面：

（1）本轮市场的流动性以及市场杠杆都控制的很好。过去都是“水牛”，而本轮市场的走强不仅仅是流动性推动，因此，只要货币政策没有彻底转向，市场不会轻易拐头；

（2）本轮市场的主要逻辑来自转型牛。资本市场被政府给予了新的任务和使命，通过帮助新兴产业实现输血而实现经济的转型，因此，市场的适当繁荣是经济转型的重要助力；

（3）本轮转型已经到了背水一战之时。美国的贸易战使得全国人民都意识到了经济转型已经到了迫在眉睫的时候，这与1853年日本的“黑船事件”有异曲同工之处，正是因为外在的力量，使得转型动力和必然性远远超过历史任何一次经历；

（4）本轮市场有产业逻辑的配合。本轮市场的上涨中，有半导体、5g、创新药、云计算等等一系列产业的逻辑支撑，因此不是简单的估值提升，其持续性也必然会较以往更好；

（5）本轮市场的走强有持续增量资金的配合。由于银行理财净值化以及可投资产越来越少的影响，银行理财必须通过部分权益配置来实现收益率的增强，此外，外资、产业资本也在持续流入，因此增量资金的持续流入也会导致本轮市场持续的时间更长。

综上，我们认为在这种市场中，只要没有系统性风险，就是机构投资者大展身手的时候，相信专业的力量，与时间为伴，必然会带来较好的回报。

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》，与申万宏源证券有限公司于2019年9月签订了《运营服务合同》、于2020年5月签订了《基金运营服务合同》。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

本基金完成转型后，《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

本报告期内本基金未进行过利润分配。

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多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）的管理人--财通基金管理有限公司在财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）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，财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

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

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多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）2020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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	11,535,489.37	134,558,082.35
结算备付金		215,847.07	-
存出保证金		54,101.91	10,056.37
交易性金融资产	6.4.7.2	129,001,434.17	30,443,195.00
其中：股票投资		129,001,434.17	30,443,195.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		112,050.05	-

应收利息	6.4.7.5	1,035.14	31,425.72
应收股利		-	-
应收申购款		50,547.73	998.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		140,970,505.44	165,043,757.94
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019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		-	-
应付证券清算款		-	9,245,131.26
应付赎回款		245,457.49	437,868.41
应付管理人报酬		157,557.63	220,099.71
应付托管费		26,259.62	36,683.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	83,444.46	25,302.41
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	84,535.36	170,000.00
负债合计		597,254.56	10,135,085.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	147,353,365.12	201,822,669.84
未分配利润	6.4.7.10	-6,980,114.24	-46,913,996.96
所有者权益合计		140,373,250.88	154,908,672.88
负债和所有者权益总计		140,970,505.44	165,043,757.94

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2020年6月30日，基金份额净值0.9526元，基金份额总额147,353,365.12份。

6.2 利润表

会计主体：财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01日 至2020年06月30日
一、收入		29,322,304.96
1.利息收入		71,235.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	71,235.29
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-640,156.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-953,719.38
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	313,562.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	29,876,812.75
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	14,413.32
减：二、费用		1,818,261.44
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	982,266.48
2．托管费	6.4.10.2.2	163,711.03

3．销售服务费		-
4．交易费用	6.4.7.20	561,460.29
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	6.4.7.21	110,823.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,504,043.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,504,043.52

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：财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020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)	201,822,669.84	-46,913,996.96	154,908,672.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,504,043.52	27,504,043.52
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）	-54,469,304.72	12,429,839.20	-42,039,465.52
其中：1.基金申购款	1,158,583.35	-264,713.68	893,869.67
2.基金赎回款	-55,627,888.07	12,694,552.88	-42,933,335.19
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）	147,353,365.12	-6,980,114.24	140,373,250.88

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	刘为臻	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

财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）(以下简称"本基金")由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转型而成，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。根据《财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》及《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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自2019年12月28日起转型为上市开放式基金（LOF）并更名为财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）。本基金为上市契约型开放式，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）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、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：本基金投资于股票资产的比例为50%~95%；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。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。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

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自2019年12月28日起转为上市开放式基金（LOF）。基金名称变更为"财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）"，基金简称变更为"财通福盛混合发起（LOF）"。

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》、《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>》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2020年6月30日的财务状况以及自2020年1月1日起至2020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。

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 2020年06月30日
活期存款	11,535,489.37
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	11,535,489.37

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2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		98,593,183.33	129,001,434.17	30,408,250.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		98,593,183.33	129,001,434.17	30,408,250.84

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 2020年06月30日
应收活期存款利息	925.79
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	87.39
应收债券利息	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	21.96
合计	1,035.14

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

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	83,444.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	83,444.46

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
预提费用	84,535.36
合计	84,535.36

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	201,822,669.84	201,822,669.84
本期申购	1,158,583.35	1,158,583.35
本期赎回（以“-”号填列）	-55,627,888.07	-55,627,888.07
本期末	147,353,365.12	147,353,365.12

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	-67,881,339.83	20,967,342.87	-46,913,996.96
本期利润	-2,372,769.23	29,876,812.75	27,504,043.52
本期基金份额交易产生的变动数	19,015,075.40	-6,585,236.20	12,429,839.20
其中：基金申购款	-411,800.55	147,086.87	-264,713.68
基金赎回款	19,426,875.95	-6,732,323.07	12,694,552.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-51,239,033.66	44,258,919.42	-6,980,114.24

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	67,422.62
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	3,518.83

其他	293.84
合计	71,235.29

注：本基金本期末其他项目包括结算保证金利息收入和应收申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	185,979,493.38
减：卖出股票成本总额	186,933,212.76
买卖股票差价收入	-953,719.38

6.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期未有证券出借差价收入。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期未有基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期债券投资收益为零。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期未有买卖债券差价收入。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.14.5 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	313,562.98
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	313,562.98

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1.交易性金融资产	29,876,812.75

——股票投资	29,876,812.75
——债券投资	-
——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	29,876,812.75

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	14,413.32
合计	14,413.32

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	561,460.29
银行间市场交易费用	-
合计	561,460.29

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
帐户维护费	18,600.00
其他费用	7,688.28
合计	110,823.64

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2020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 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	982,266.48
其中：支付销售机构的客户维护费	286,907.27

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 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	163,711.03

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 2020年01月01日至2020年06月30日
基金合同生效日（2019年12月28日）持有的基金份额	10,000,350.00
报告期初持有的基金份额	10,000,350.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,350.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.79%

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末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 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	11,535,489.37	67,422.62

注：(1)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。

(2)本基金于2019年12月28日转型，无比较式的上年度数据。

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。

本基金于本报告披露前，资产负债表日后通过网上申购方式参与关联方财通证券股份有限公司承销的天普股份(股票代码：605255)。本基金投资关联方承销的证券行为符合法律法规的规定及基金合同约定的投资范围，且未对份额持有人利益产生实质不利影响，未发现与基金管理人、基金托管人利益冲突情况。

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（2020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
688189	南新制药	2020-03-18	2020-09-26	新股限售	34.94	50.21	2,112	73,793.28	106,043.52	注
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	认购新发证券	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	认购新发证券	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
3008	酷特	2020-	2020-	认购	5.94	5.94	1,185	7,03	7,03	-

40	智能	06-30	07-08	新发证券				8.90	8.90	
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	认购新发证券	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：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。

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，两者依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，因此除在本报告附注中已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2020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	11,535,489.37	-	-	-	-	-	11,535,489.37
结算备付金	215,847.07	-	-	-	-	-	215,847.07
存出保证金	54,101.91	-	-	-	-	-	54,101.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	129,001,434.17	129,001,434.17
应收证券清算款	-	-	-	-	-	112,050.05	112,050.05
应收利息	-	-	-	-	-	1,035.14	1,035.14

应收申购款	-	-	-	-	-	50,547.73	50,547.73
资产总计	11,805,438.35	-	-	-	-	129,165,067.09	140,970,505.44
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	245,457.49	245,457.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	157,557.63	157,557.63
应付托管费	-	-	-	-	-	26,259.62	26,259.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	83,444.46	83,444.46
其他负债	-	-	-	-	-	84,535.36	84,535.36
负债总计	-	-	-	-	-	597,254.56	597,254.56
利率敏感度缺口	11,805,438.35	-	-	-	-	128,567,812.53	140,373,250.88
上年度末2019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	134,558,082.35	-	-	-	-	-	134,558,082.35
存出保证金	10,056.37	-	-	-	-	-	10,056.37
交易性金融资产	-	-	-	-	-	30,443,195.00	30,443,195.00
应收利息	-	-	-	-	-	31,425.72	31,425.72
应收申购款	-	-	-	-	-	998.50	998.50
资产总计	134,568,138.72	-	-	-	-	30,475,619.22	165,043,757.94
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,245,131.26	9,245,131.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	437,868.41	437,868.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	220,099.71	220,099.71
应付托管费	-	-	-	-	-	36,683.27	36,683.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,302.41	25,302.41
其他负债	-	-	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	10,135,085.	10,135,08

						06	5.06
利率敏感度缺口	134,568,138.72	-	-	-	-	20,340,534.16	154,908,672.88

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至报告期末，本基金无交易性债券投资，因此利率风险因素对于本基金资产净值无重大影响。

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 2020年06月30日	上年度末 2019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	129,001,434.17	91.90	30,443,195.00	19.65
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	129,001,434.17	91.90	30,443,195.00	19.65

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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准增加1%	2,393,720.49	-
	业绩比较基准减少1%	-2,393,720.49	-

注：本基金于2019年12月28日转型，本基金上期末处于建仓期，未对其他价格敏感性进行分析。

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2020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128,868,736.67元、属于第二层次的余额为人民币26,653.98元，属于第三层次的余额为人民币106,043.52元。

于2019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2,227,528.00元、无属于第二层次和第三层次的余额。

(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

-

转入第三层次

-

转出第三层次

-

当期计入损益的利得或损失总额

32,250.24

购买

73,793.28

出售

-

本期末

106,043.52

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

32,250.24

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	129,001,434.17	91.51
	其中：股票	129,001,434.17	91.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,751,336.44	8.34
8	其他各项资产	217,734.83	0.15
9	合计	140,970,505.44	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	98,256,285.23	70.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,287,718.01	1.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,910,543.21	7.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,566,256.59	2.54
M	科学研究和技术服务业	8,197,476.00	5.84
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	2,859,534.81	2.04
R	文化、体育和娱乐业	2,910,854.00	2.07
S	综合	-	-
	合计	129,001,434.17	91.90

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	002475	立讯精密	204,761	10,514,477.35	7.49
2	603259	药明康德	84,860	8,197,476.00	5.84
3	600519	贵州茅台	5,456	7,981,473.28	5.69
4	600276	恒瑞医药	77,486	7,151,957.80	5.09
5	603456	九洲药业	241,676	6,549,419.60	4.67

6	300601	康泰生物	37,319	6,051,649.04	4.31
7	002384	东山精密	190,337	5,700,593.15	4.06
8	688008	澜起科技	54,437	5,535,154.16	3.94
9	300433	蓝思科技	195,001	5,467,828.04	3.90
10	688111	金山办公	14,406	4,920,801.48	3.51
11	600183	生益科技	142,384	4,167,579.68	2.97
12	300253	卫宁健康	173,420	3,978,254.80	2.83
13	002241	歌尔股份	131,100	3,849,096.00	2.74
14	300502	新易盛	60,140	3,796,036.80	2.70
15	603005	晶方科技	47,800	3,759,948.00	2.68
16	601888	中国中免	23,153	3,566,256.59	2.54
17	000799	酒鬼酒	46,400	3,550,064.00	2.53
18	601012	隆基股份	81,300	3,311,349.00	2.36
19	600438	通威股份	179,800	3,124,924.00	2.23
20	300413	芒果超媒	44,645	2,910,854.00	2.07
21	002044	美年健康	198,441	2,859,534.81	2.04
22	600703	三安光电	113,879	2,846,975.00	2.03
23	002050	三花智控	127,220	2,786,118.00	1.98
24	000063	中兴通讯	67,000	2,688,710.00	1.92
25	002460	赣锋锂业	47,300	2,533,861.00	1.81
26	600009	上海机场	31,743	2,287,718.01	1.63
27	002912	中新赛克	11,500	1,881,285.00	1.34
28	300750	宁德时代	9,700	1,691,292.00	1.20
29	600885	宏发股份	38,300	1,536,596.00	1.09
30	688012	中微公司	6,048	1,326,386.88	0.94
31	002916	深南电路	6,480	1,085,529.60	0.77
32	000977	浪潮信息	27,100	1,061,778.00	0.76
33	002624	完美世界	2,049	118,104.36	0.08
34	688189	南新制药	2,112	106,043.52	0.08
35	603087	甘李药业	365	36,609.50	0.03
36	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01

37	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
38	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
39	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
40	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
41	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
42	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

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	002384	东山精密	9,906,234.00	6.39
2	002475	立讯精密	8,194,932.00	5.29
3	002044	美年健康	6,907,263.00	4.46
4	603456	九洲药业	6,732,314.00	4.35
5	300601	康泰生物	6,687,027.50	4.32
6	600009	上海机场	6,684,894.30	4.32
7	603160	汇顶科技	6,539,330.00	4.22
8	002241	歌尔股份	6,229,120.00	4.02
9	603501	韦尔股份	5,979,351.00	3.86
10	300433	蓝思科技	5,802,946.00	3.75
11	688111	金山办公	5,784,998.58	3.73
12	603259	药明康德	5,549,244.54	3.58
13	600276	恒瑞医药	5,391,412.36	3.48
14	688008	澜起科技	5,261,004.67	3.40
15	000802	北京文化	5,138,321.00	3.32
16	002174	游族网络	5,081,925.00	3.28
17	600183	生益科技	4,796,222.70	3.10
18	000063	中兴通讯	4,643,656.00	3.00
19	600519	贵州茅台	4,413,444.00	2.85

20	600436	片仔癀	4,270,914.60	2.76
21	300383	光环新网	3,901,881.00	2.52
22	002456	欧菲光	3,897,828.00	2.52
23	300413	芒果超媒	3,843,980.00	2.48
24	002555	三七互娱	3,674,100.00	2.37
25	002008	大族激光	3,670,207.00	2.37
26	002624	完美世界	3,667,305.00	2.37
27	000799	酒鬼酒	3,665,490.20	2.37
28	002507	涪陵榨菜	3,656,400.48	2.36
29	603005	晶方科技	3,633,040.00	2.35
30	002080	中材科技	3,491,202.41	2.25
31	600703	三安光电	3,420,251.00	2.21
32	603882	金域医学	3,316,225.00	2.14
33	300253	卫宁健康	3,213,247.00	2.07
34	002273	水晶光电	3,209,494.00	2.07
35	600699	均胜电子	3,138,778.00	2.03

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	603160	汇顶科技	7,860,927.41	5.07
2	600009	上海机场	6,737,029.50	4.35
3	300601	康泰生物	5,899,450.37	3.81
4	002507	涪陵榨菜	5,786,504.46	3.74
5	603501	XD韦尔股	4,961,808.78	3.20
6	002174	游族网络	4,909,727.32	3.17
7	600436	片仔癀	4,755,274.91	3.07
8	002555	三七互娱	4,491,758.50	2.90
9	688111	金山办公	4,319,122.47	2.79

10	601318	中国平安	4,312,985.45	2.78
11	600036	招商银行	4,296,457.04	2.77
12	002241	歌尔股份	4,291,877.88	2.77
13	002384	东山精密	4,027,077.94	2.60
14	000802	北京文化	3,847,975.10	2.48
15	002475	立讯精密	3,832,728.38	2.47
16	300015	爱尔眼科	3,830,914.77	2.47
17	300383	光环新网	3,605,624.72	2.33
18	603882	金域医学	3,597,915.42	2.32
19	002008	大族激光	3,569,288.47	2.30
20	603721	中广天择	3,558,785.82	2.30
21	002080	中材科技	3,475,568.76	2.24
22	002624	完美世界	3,421,672.17	2.21
23	000661	长春高新	3,228,583.89	2.08
24	002456	欧菲光	3,195,448.46	2.06
25	002044	美年健康	3,183,526.55	2.06
26	600060	海信视像	3,113,413.52	2.01

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	255,614,639.18
卖出股票收入（成交）总额	185,979,493.38

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 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，本基金投资的前十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。

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	54,101.91
2	应收证券清算款	112,050.05
3	应收股利	-
4	应收利息	1,035.14
5	应收申购款	50,547.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	217,734.83

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
2,313	63,706.60	50,004,750.00	33.940%	97,348,615.12	66.060%

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	谢世祺	1,190,000.00	45.19
2	钱中明	287,689.00	10.92
3	张玲芝	187,808.00	7.13
4	陈华玲	98,863.00	3.75
5	蒋佟华	98,832.00	3.75
6	马洪军	54,360.00	2.06
7	魏咏梅	51,700.00	1.96
8	黄国玲	50,713.00	1.93
9	黄建碧	50,000.00	1.90
10	王媛	49,429.00	1.88

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	14,076.90	0.01%

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

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	6.79%	10,000,350.00	6.79%	自基金合同生效日起不少于3年
基金管理人高	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

级管理人员					
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	6.79%	10,000,350.00	6.79%	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(2019年12月28日)基金份额总额	203,109,821.75
本报告期期初基金份额总额	201,822,669.84
本报告期基金总申购份额	1,158,583.35
减：本报告期基金总赎回份额	55,627,888.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	147,353,365.12

§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2020年6月1日聘任唐静波女士担任公司第四届董事会董事职务，原董事孙文秋先生于2020年6月1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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	24,436,103.63	5.55%	17,381.25	5.18%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	23,868,177.48	5.42%	17,006.60	5.07%	-
东北证券	2	18,675,783.67	4.24%	13,284.59	3.96%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	24,467,368.77	5.55%	17,403.42	5.19%	-
国盛证券	2	63,689,71	14.45%	46,170.5	13.77%	-

		5.18		0		
国泰君安	2	2,518,292.45	0.57%	1,841.73	0.55%	-
国信证券	2	3,025,074.81	0.69%	2,151.77	0.64%	-
海通证券	2	67,798,419.81	15.39%	48,442.62	14.44%	-
华创证券	2	993,506.98	0.23%	726.54	0.22%	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	948,565.55	0.22%	693.70	0.21%	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	5,865,795.00	1.33%	4,172.31	1.24%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	5,086,261.36	1.15%	3,719.62	1.11%	-
西南证券	2	22,677,582.39	5.15%	20,800.69	6.20%	-
湘财证券	2	12,084,024.93	2.74%	11,012.15	3.28%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	10,283,263.00	2.33%	9,576.85	2.86%	-
中国中投证券	2	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	21,537,214.73	4.89%	15,511.38	4.62%	-
中信建投证券	2	3,511,874.27	0.80%	2,568.23	0.77%	-
中信证券	2	45,943,697.17	10.43%	42,787.51	12.76%	-
东兴证券	3	10,845,671.89	2.46%	7,931.47	2.36%	-
安信证券	4	29,293,561.51	6.65%	21,262.71	6.34%	-
方正证券	4	2,558,353.93	0.58%	1,819.69	0.54%	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	4	40,543,522.72	9.20%	29,118.72	8.68%	-

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

本报告期内无基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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2019年度资产净值的公告（截至12月31日）》	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-01

2	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万家财富基金销售（天津）有限公司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	2020-01-04
3	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加方正证券股份有限公司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	2020-01-07
4	《关于财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）参加浙江同花顺基金销售有限公司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	2020-01-08
5	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金参与中国农业银行股份有限公司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	2020-01-11
6	《财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）2019年第四季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-17
7	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加代销机构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	2020-01-23
8	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-03
9	《财通基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-14
10	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加方德保险代理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	2020-03-20
11	《财通基金管理有限公司关于推	中国证监会指定报刊	2020-03-28

	迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告》	及网站	
12	《财通基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01
13	《财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）2019年年度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-18
14	《财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）2020年第一季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
15	《财通基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-30
16	《财通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申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-18
17	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加大连网金基金销售有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-26
18	《关于财通基金客服热线相关业务暂停服务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-05
19	《财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2020年6月13日公告）》及其摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-13
20	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加恒泰证券股份有限公司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	2020-06-18

§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	2020-01-06至2020-06-30	40,004,400.00	0.00	0.00	40,004,400.00	27.15%
产品特有风险							
本计划可投资资产支持证券，需关注与基础资产相关的风险、与资产支持证券相关的风险及其他风险；在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。组合现货的β可能不足或者过高，组合风险敞口过大，股指期货空头头寸不能完全对冲现货的风险，组合存在系统性暴露的风险。股指期货是一种高风险的投资工具，实行保证金交易制度具有杠杆性，高杠杆效应放大了价格的波动风险；当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使委托资产遭受较大损失；基金投资有明确锁定期的非公开发行股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，故本基金的净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值，投资者在申购赎回或在场内交易时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。另外，本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险；本基金在基金合同生效且符合上市交易条件后，在上海证券交易所挂牌上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金,产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。 在报告期内，本基金单一投资者持有的基金份额已超过20%，可能对基金运作造成如下风险： (1)赎回申请延缓支付的风险 该等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小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付赎回款项的风险。 (2)基金净值大幅波动的风险 该等投资者大额赎回时，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)基金规模过小导致的风险
该等投资者赎回后，很可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。

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、财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）基金合同；
3、财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）基金托管协议；
4、财通福盛多策略混合型发起式证券投资基金（LOF）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

二〇二〇年八月二十九日