

财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 28 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021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	6
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	7
§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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	58
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	58
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	58

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12	投资组合报告附注	58
§8	基金份额持有人信息	60
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§9	开放式基金份额变动	60
§10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8	其他重大事件	63
§11	影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	66
§12	备查文件目录	66
12.1	备查文件目录	66
12.2	存放地点	66
12.3	查阅方式	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	财通量化价值优选混合
场内简称	-
基金主代码	005850
交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2019年01月30日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	111,136,408.45份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金量化投资模型主要包括运用多因子alpha模型进行股票超额回报预测，通过风险估测模型有效控制预期风险，借助交易成本模型控制交易成本以保护投资业绩，同时对投资组合的优化和调整；本基金固定收益类资产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；本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资；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；本基金将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×75%+上证国债指数收益率×25%
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	中国光大银行股份有限公司
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	95595
传真	021-20537999	010-63639132
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200120	100033
法定代表人	夏理芬	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ctfund.com
基金中期报告备置地	基金管理人和基金托管人办公地址

点	
---	--

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼

§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（2021年01月01日-2021年06月30日）
本期已实现收益	25,892,120.57
本期利润	20,167,498.64
加权平均基金份额本期利润	0.1952
本期加权平均净值利润率	11.95%
本期基金份额净值增长率	11.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021年06月30日）
期末可供分配利润	70,363,586.28
期末可供分配基金份额利润	0.6331
期末基金资产净值	190,277,920.03
期末基金份额净值	1.7121
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021年06月30日）
基金份额累计净值增长率	71.21%

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。

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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.79%	0.76%	-1.47%	0.61%	2.26%	0.15%
过去三个月	7.91%	0.90%	2.87%	0.73%	5.04%	0.17%
过去六个月	11.16%	1.27%	0.79%	0.99%	10.37%	0.28%
过去一年	35.83%	1.25%	19.74%	1.00%	16.09%	0.25%
自基金合同生效起至今	71.21%	1.22%	49.42%	1.01%	21.79%	0.21%

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×75%+上证国债指数收益率×25%。

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：(1)本基金合同生效日为2019年01月30日；

(2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月，截至本报告期末，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173人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在7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		
朱海东	本基金的基金经理、量化投资一部总监助理（主持工作）	2019-07-16	-	9年	复旦大学理学硕士。历任银河基金量化研究员，平安资管量化投资部研究经理，负责产品投资管理以及量化模型开发工作。2019年6月加入财通基金管理有限公司，现任量化投资一部总监助理（主持工作）、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。

4.2 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

报告期内，本基金组合采用量化模型，控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，追求相对基准的长期稳定的超额收益，并在投资上积极参与新股申购，相对业绩基准创造出了超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通量化价值优选混合基金份额净值为1.7121元，本报告期内，基金份额净值增长率为11.16%，同期业绩比较基准收益率为0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，PPI与CPI剪刀差位于历史极值附近，经济存在一定的压力，而国内货币环境相对宽松，在这样的宏观背景下，我们看好成长风格继续优秀表现。同时，我们判断消费板块参与性价比越来越高，值得关注。对于周期板块，我们认为其性价比正在逐步下降。

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《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%。

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，中国光大银行股份有限公司在财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，

没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,635,717.08	13,720,928.11
结算备付金		1,131,491.94	1,251,037.64
存出保证金		76,453.71	86,780.12
交易性金融资产	6.4.7.2	177,745,809.47	187,007,867.23
其中：股票投资		177,583,349.87	187,007,867.23
基金投资		-	-
债券投资		162,459.60	-

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		500,650.87	3,695,790.58
应收利息	6.4.7.5	2,878.48	3,317.45
应收股利		-	-
应收申购款		2,521.75	8,131.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		191,095,523.30	205,773,852.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		73,468.54	-
应付赎回款		70.09	4,500,552.45
应付管理人报酬		223,243.55	254,377.61
应付托管费		37,207.26	42,396.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	399,310.90	555,746.78
应交税费		0.34	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,302.59	189,446.57
负债合计		817,603.27	5,542,519.69

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	111,136,408.45	130,005,334.85
未分配利润	6.4.7.10	79,141,511.58	70,225,998.39
所有者权益合计		190,277,920.03	200,231,333.24
负债和所有者权益总计		191,095,523.30	205,773,852.93

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2021年6月30日，基金份额净值1.7121元，基金份额总额111,136,408.45份。

6.2 利润表

会计主体：财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		23,216,296.50	-4,351,819.51
1.利息收入		47,338.05	46,700.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	47,297.54	46,700.87
债券利息收入		40.51	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,743,920.48	8,004,599.16
其中：股票投资收益	6.4.7.12	27,155,668.19	7,630,255.91
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	1,588,252.29	374,343.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-5,724,621.93	-12,552,797.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	149,659.90	149,677.64
减：二、费用		3,048,797.86	2,756,793.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,256,412.26	918,447.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	209,401.95	153,074.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,498,680.98	1,595,763.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.11	-
7. 其他费用	6.4.7.21	84,302.56	89,507.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,167,498.64	-7,108,612.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,167,498.64	-7,108,612.92

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：财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021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)	130,005,334.85	70,225,998.39	200,231,333.24
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	20,167,498.64	20,167,498.64
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)	-18,868,926.40	-11,251,985.45	-30,120,911.85
其中：1.基金申购款	21,215,738.99	13,600,999.19	34,816,738.18
2.基金赎回 款	-40,084,665.39	-24,852,984.64	-64,937,650.03
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)	111,136,408.45	79,141,511.58	190,277,920.03
项目	上年度可比期间 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)	206,698,677.58	33,124,855.34	239,823,532.92
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	-7,108,612.92	-7,108,612.92
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)	-172,466,417.53	-17,097,542.21	-189,563,959.74
其中：1.基金申购款	14,427,127.28	2,423,039.27	16,850,166.55

2.基金赎回款	-186,893,544.81	-19,520,581.48	-206,414,126.29
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）	34,232,260.05	8,918,700.21	43,150,960.26

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

财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金（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”）证监许可[2018]540号文《关于准予财通量化价值优选灵活配置混合型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自2018年12月24日到2019年1月24日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第60951782_B01号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年1月30日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币458,952,613.34元，在募集期间产生的存款利息为人民币27,529.54元，以上实收基金（本息）合计为人民币458,980,142.88元，折合458,980,142.88份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括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、存托凭证）、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、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、

权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。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。

本基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，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，现金或者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。

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

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 2021年06月30日
活期存款	11,635,717.08
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	11,635,717.08

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2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		172,122,709.63	177,583,349.87	5,460,640.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	111,000.00	162,459.60	51,459.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	111,000.00	162,459.60	51,459.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		172,233,709.63	177,745,809.47	5,512,099.84

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 2021年06月30日
应收活期存款利息	2,293.52

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	509.20
应收债券利息	41.36
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	34.40
合计	2,878.48

注：其他为结算保证金利息。

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 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	399,310.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	399,310.90

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.03
预提费用	84,302.56
合计	84,302.59

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	130,005,334.85	130,005,334.85
本期申购	21,215,738.99	21,215,738.99
本期赎回（以“-”号填列）	-40,084,665.39	-40,084,665.39
本期末	111,136,408.45	111,136,408.45

注：本期申购含红利再投、转换入份额，本期赎回含转换出份额。

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	50,551,946.22	19,674,052.17	70,225,998.39
本期利润	25,892,120.57	-5,724,621.93	20,167,498.64
本期基金份额交易产生的变动数	-6,080,480.51	-5,171,504.94	-11,251,985.45
其中：基金申购款	12,393,101.91	1,207,897.28	13,600,999.19
基金赎回款	-18,473,582.42	-6,379,402.22	-24,852,984.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	70,363,586.28	8,777,925.30	79,141,511.58

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	39,305.09
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	6,658.55
其他	1,333.90
合计	47,297.54

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 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	560,445,859.75
减：卖出股票成本总额	533,290,191.56
买卖股票差价收入	27,155,668.19

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**

本基金本报告期无债券投资收益。

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买卖债券赎回差价收入。

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，资产支持证券投资收益为零。

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

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

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 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,588,252.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,588,252.29

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	-5,724,621.93
——股票投资	-5,776,081.53
——债券投资	51,459.60
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允	-

价值变动产生的预估增值税	
合计	-5,724,621.93

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	149,659.90
合计	149,659.90

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	1,498,680.98
银行间市场交易费用	-
合计	1,498,680.98

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
合计	84,302.56

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2021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
中国光大银行股份有限公司("中国光大银行")	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
财通证券	17,823,954.67	1.65%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	12,852.27	1.54%	12,852.27	3.22%

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 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	1,256,412.26	918,447.95
其中：支付销售机构的客户维护费	17,676.65	35,293.57

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 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	209,401.95	153,074.61

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	11,635,717.08	39,305.09	4,240,326.37	38,984.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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

本基金上年度可比期间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

本基金本报告期无其他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——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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
688396	华润微	2021-04-28	2021-10-26	非公开发行锁定	48.00	83.97	29,167	1,400,016.00	2,449,152.99	-
300373	扬杰科技	2021-01-26	2021-07-28	非公开发行锁定	37.00	58.37	40,541	1,500,017.00	2,366,378.17	-
002673	西部证券	2021-01-18	2021-07-19	非公开发行锁定	7.75	8.20	129,032	999,998.00	1,058,062.40	-
002214	大立科技	2021-02-26	2021-09-02	非公开发行锁定	19.59	18.63	51,042	999,997.85	950,912.46	-
002057	中钢天源	2021-04-01	2021-10-08	非公开发行锁定	5.56	6.71	89,928	499,999.68	603,416.88	-
002413	雷科防务	2021-02-22	2021-08-23	非公开发行锁定	5.81	6.51	86,059	500,002.79	560,244.09	-
002567	唐人神	2021-03-05	2021-09-08	非公开发行锁定	6.83	6.45	58,565	399,998.95	377,744.25	-
688680	海优新材	2021-01-15	2021-07-22	新股限售	69.94	243.61	851	59,518.94	207,312.11	-

688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股限售	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股限售	10.19	18.40	5,052	51,479.88	92,956.80	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	认购新发证券	8.29	8.29	6,905	57,242.45	57,242.45	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	8.29	768	6,366.72	6,366.72	-
688355	明志科技	2021-04-30	2021-11-12	新股限售	17.65	23.80	2,137	37,718.05	50,860.60	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	新股限售	14.48	19.21	2,623	37,981.04	50,387.83	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	认购新发证券	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	认购新发证券	10.64	10.64	3,643	38,761.52	38,761.52	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	10.64	405	4,309.20	4,309.20	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	认购新发证券	21.96	21.96	1,802	39,571.92	39,571.92	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股限售	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	109	5,158.97	27,463.64	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	认购新发证券	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-

3010 21	英诺 激光	2021- 06-28	2022- 01-06	新股 限售	9.46	9.46	290	2,74 3.40	2,74 3.40	-
3010 15	百洋 医药	2021- 06-22	2021- 12-30	新股 限售	7.64	38.83	462	3,52 9.68	17,93 9.46	-
6882 26	威腾 电气	2021- 06-28	2021- 07-07	认购 新发 证券	6.42	6.42	2,693	17,28 9.06	17,28 9.06	-
3009 53	震裕 科技	2021- 03-11	2021- 09-22	新股 限售	28.77	99.85	161	4,63 1.97	16,07 5.85	-
3009 40	南极 光	2021- 01-27	2021- 08-03	新股 限售	12.76	43.38	307	3,91 7.32	13,31 7.66	-
3009 37	药易 购	2021- 01-20	2021- 07-27	新股 限售	12.25	53.71	244	2,98 9.00	13,10 5.24	-
3009 42	易瑞 生物	2021- 02-02	2021- 08-09	新股 限售	5.31	28.52	443	2,35 2.33	12,63 4.36	-
3009 33	中辰 股份	2021- 01-15	2021- 07-22	新股 限售	3.37	10.44	1,112	3,74 7.44	11,60 9.28	-
3009 41	创识 科技	2021- 02-02	2021- 08-09	新股 限售	21.31	49.94	203	4,32 5.93	10,13 7.82	-
3009 62	中金 辐照	2021- 03-29	2021- 10-11	新股 限售	3.40	16.37	576	1,95 8.40	9,42 9.12	-
3009 56	英力 股份	2021- 03-16	2021- 09-27	新股 限售	12.85	25.80	356	4,57 4.60	9,18 4.80	-
3010 16	雷尔 伟	2021- 06-23	2021- 12-30	新股 限售	13.75	32.98	275	3,78 1.25	9,06 9.50	-
3009 45	曼卡 龙	2021- 02-03	2021- 08-10	新股 限售	4.56	18.88	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-
3009 48	冠中 生态	2021- 02-18	2021- 08-25	新股 限售	8.67	27.42	324	2,80 8.00	8,88 4.08	-
3009 31	通用 电梯	2021- 01-13	2021- 07-21	新股 限售	4.31	13.11	672	2,89 6.32	8,80 9.92	-
3009 50	德固 特	2021- 02-24	2021- 09-03	新股 限售	8.41	39.13	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-

300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	368	3,120.64	8,121.76	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	284	3,328.48	7,690.72	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	新股限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600811	东方集团	2021-06-30	筹划重大资产重组	3.05	2021-07-14	3.36	490,400	1,553,924.78	1,495,720.00	-

			组							
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具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行中国光大银行，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、组合在短期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7.4.12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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。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2021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	11,635,717.08	-	-	-	-	-	11,635,717.08
结算备付金	1,131,491.94	-	-	-	-	-	1,131,491.94
存出保证金	76,453.71	-	-	-	-	-	76,453.71
交易性金融资产	-	-	-	-	162,459.60	177,583,349.87	177,745,809.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	500,650.87	500,650.87

应收利息	-	-	-	-	-	2,878.48	2,878.48
应收申购款	-	-	-	-	-	2,521.75	2,521.75
资产总计	12,843,662.73	-	-	-	162,459.60	178,089,400.97	191,095,523.30
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	73,468.54	73,468.54
应付赎回款	-	-	-	-	-	70.09	70.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	223,243.55	223,243.55
应付托管费	-	-	-	-	-	37,207.26	37,207.26
应付交易费用	-	-	-	-	-	399,310.90	399,310.90
应交税费	-	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	-	84,302.59	84,302.59
负债总计	-	-	-	-	-	817,603.27	817,603.27
利率敏感度缺口	12,843,662.73	-	-	-	162,459.60	177,271,797.70	190,277,920.03
上年度末 2020 年 12 月 31	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

日							
资产							
银行存款	13,720,928.11	-	-	-	-	-	13,720,928.11
结算备付金	1,251,037.64	-	-	-	-	-	1,251,037.64
存出保证金	86,780.12	-	-	-	-	-	86,780.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	187,007,867.23	187,007,867.23
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,695,790.58	3,695,790.58
应收利息	-	-	-	-	-	3,317.45	3,317.45
应收申购款	-	-	-	-	-	8,131.80	8,131.80
资产总计	15,058,745.87	-	-	-	-	190,715,107.06	205,773,852.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,500,552.45	4,500,552.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	254,377.61	254,377.61
应付托管费	-	-	-	-	-	42,396.28	42,396.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	555,746.78	555,746.78
其他	-	-	-	-	-	189,446.57	189,446.57

负债							
负债总计	-	-	-	-	-	5,542,519.69	5,542,519.69
利率敏感度缺口	15,058,745.87	-	-	-	-	185,172,587.37	200,231,333.24

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末未持有交易性固定收益类投资（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动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。本基金投资组合中，股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，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，现金或者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。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 2021年06月30日		上年度末 2020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	177,583,349.87	93.33	187,007,867.23	93.40
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	162,459.60	0.09	-	-
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	177,745,809.47	93.41	187,007,867.23	93.40

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取决于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及行业比较基准的变动。		
	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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准增加1%	2,339,290.63	2,534,959.09
	业绩比较基准减少1%	-2,339,290.63	-2,534,959.09

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2021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166,834,567.09元，属于第二层次的余额为人民币1,717,521.79元，属于第三层次的余额为人民币9,193,720.59元（于2020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186,439,890.70元，属于第二层次的余额为人民币134,818.40元，属于第三层次的余额为人民币433,158.13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	433,158.13	
转入第三层次	-	
转出第三层次	216,008.65	
当期计入损益的利得或损失总额	2,627,018.64	
购买	6,624,273.15	
出售	274,720.68	
本期末	9,193,720.59	
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	2,562,678.97	

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	177,583,349.87	92.93
	其中：股票	177,583,349.87	92.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	162,459.60	0.09
	其中：债券	162,459.60	0.09
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,767,209.02	6.68
8	其他各项资产	582,504.81	0.30
9	合计	191,095,523.30	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	2,536,680.56	1.33
B	采矿业	4,598,302.86	2.42
C	制造业	103,710,659.98	54.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,404,877.00	1.26

E	建筑业	4,596,549.00	2.42
F	批发和零售业	1,409,967.82	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	3,783,180.00	1.99
H	住宿和餐饮业	159,862.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,268,987.89	2.24
J	金融业	32,444,989.08	17.05
K	房地产业	3,514,048.64	1.85
L	租赁和商务服务业	6,954,879.85	3.66
M	科学研究和技术服务业	1,639,497.30	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	686,510.89	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	189,720.00	0.10
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,105,689.00	1.63
R	文化、体育和娱乐业	1,578,948.00	0.83
S	综合	-	-
	合计	177,583,349.87	93.33

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	000333	美的集团	123,992	8,849,309.04	4.65
2	600036	招商银行	140,300	7,602,857.00	4.00
3	601012	隆基股份	72,148	6,409,628.32	3.37
4	300059	东方财富	194,101	6,364,571.79	3.34
5	000858	五粮液	19,719	5,874,092.91	3.09
6	601888	中国中免	18,455	5,538,345.50	2.91

7	600031	三一重工	170,697	4,962,161.79	2.61
8	600519	贵州茅台	2,325	4,781,827.50	2.51
9	601318	中国平安	62,612	4,024,699.36	2.12
10	601668	中国建筑	621,200	2,888,580.00	1.52
11	002714	牧原股份	41,708	2,536,680.56	1.33
12	600887	伊利股份	67,905	2,500,941.15	1.31
13	600809	山西汾酒	5,500	2,464,000.00	1.29
14	688396	华润微	29,217	2,453,703.99	1.29
15	002563	森马服饰	198,500	2,372,075.00	1.25
16	300373	扬杰科技	40,541	2,366,378.17	1.24
17	600309	万华化学	19,800	2,154,636.00	1.13
18	000651	格力电器	39,557	2,060,919.70	1.08
19	601919	中远海控	67,300	2,055,342.00	1.08
20	600276	恒瑞医药	29,392	1,997,774.24	1.05
21	601225	陕西煤业	164,400	1,948,140.00	1.02
22	601336	新华保险	40,800	1,873,128.00	0.98
23	002179	中航光电	23,700	1,872,774.00	0.98
24	601636	旗滨集团	97,300	1,805,888.00	0.95
25	601899	紫金矿业	176,894	1,714,102.86	0.90
26	600779	水井坊	13,400	1,693,090.00	0.89
27	000656	金科股份	284,146	1,645,205.34	0.86
28	603259	药明康德	10,470	1,639,497.30	0.86
29	002056	横店东磁	121,700	1,582,100.00	0.83
30	601390	中国中铁	300,000	1,572,000.00	0.83
31	002839	张家港行	275,300	1,497,632.00	0.79
32	600811	东方集团	490,400	1,495,720.00	0.79
33	000581	威孚高科	71,400	1,487,262.00	0.78
34	000598	兴蓉环境	285,200	1,485,892.00	0.78
35	601098	中南传媒	167,400	1,476,468.00	0.78
36	002948	青岛银行	286,600	1,424,402.00	0.75
37	002027	分众传媒	150,535	1,416,534.35	0.74

38	601006	大秦铁路	193,100	1,270,598.00	0.67
39	300274	阳光电源	10,900	1,254,154.00	0.66
40	600585	海螺水泥	30,467	1,250,670.35	0.66
41	000568	泸州老窖	5,239	1,236,089.66	0.65
42	300015	爱尔眼科	17,385	1,233,987.30	0.65
43	000001	平安银行	52,200	1,180,764.00	0.62
44	300124	汇川技术	15,805	1,173,679.30	0.62
45	000725	京东方 A	177,500	1,107,600.00	0.58
46	603444	吉比特	2,000	1,060,000.00	0.56
47	002673	西部证券	129,032	1,058,062.40	0.56
48	600522	中天科技	103,700	1,037,000.00	0.54
49	600048	保利地产	84,500	1,017,380.00	0.53
50	688111	金山办公	2,519	994,501.20	0.52
51	601939	建设银行	146,910	976,951.50	0.51
52	000683	远兴能源	206,400	963,888.00	0.51
53	002214	大立科技	51,042	950,912.46	0.50
54	600406	国电南瑞	40,775	947,611.00	0.50
55	601881	中国银河	85,479	921,463.62	0.48
56	300143	盈康生命	34,500	888,720.00	0.47
57	002142	宁波银行	22,445	874,681.65	0.46
58	603195	公牛集团	4,100	828,200.00	0.44
59	603833	欧派家居	5,813	825,213.48	0.43
60	002475	立讯精密	17,415	801,090.00	0.42
61	688356	键凯科技	2,300	755,550.00	0.40
62	600837	海通证券	62,400	717,600.00	0.38
63	000786	北新建材	18,000	706,500.00	0.37
64	300308	中际旭创	18,100	697,212.00	0.37
65	603678	火炬电子	10,200	688,500.00	0.36
66	002415	海康威视	10,654	687,183.00	0.36
67	600702	舍得酒业	3,200	684,096.00	0.36
68	600690	海尔智家	26,300	681,433.00	0.36

69	002430	杭氧股份	19,700	681,423.00	0.36
70	000915	华特达因	25,341	677,364.93	0.36
71	603035	常熟汽饰	41,500	676,450.00	0.36
72	000977	浪潮信息	23,900	672,307.00	0.35
73	603486	科沃斯	2,900	661,432.00	0.35
74	600475	华光环能	64,307	655,931.40	0.34
75	300740	水羊股份	31,400	655,632.00	0.34
76	600096	云天化	46,200	648,648.00	0.34
77	002833	弘亚数控	16,600	643,250.00	0.34
78	002705	新宝股份	24,450	641,812.50	0.34
79	600019	宝钢股份	84,000	641,760.00	0.34
80	688016	心脉医疗	1,400	636,454.00	0.33
81	000550	江铃汽车	26,900	630,267.00	0.33
82	603489	八方股份	2,666	630,189.08	0.33
83	000100	TCL科技	82,300	629,595.00	0.33
84	601699	潞安环能	52,900	624,749.00	0.33
85	300529	健帆生物	7,200	621,792.00	0.33
86	300394	天孚通信	24,480	619,833.60	0.33
87	601717	郑煤机	53,000	616,390.00	0.32
88	002057	中钢天源	89,928	603,416.88	0.32
89	002594	比亚迪	2,400	602,400.00	0.32
90	600763	通策医疗	1,400	575,400.00	0.30
91	002413	雷科防务	86,059	560,244.09	0.29
92	601838	成都银行	42,700	539,728.00	0.28
93	600436	片仔癀	1,200	537,960.00	0.28
94	300122	智飞生物	2,875	536,848.75	0.28
95	600546	山煤国际	74,300	533,474.00	0.28
96	000338	潍柴动力	29,250	522,697.50	0.27
97	601688	华泰证券	31,086	491,158.80	0.26
98	600570	恒生电子	5,090	474,642.50	0.25
99	601375	中原证券	96,300	468,981.00	0.25

100	603288	海天味业	3,465	446,811.75	0.23
101	300014	亿纬锂能	4,200	436,506.00	0.23
102	600900	长江电力	21,100	435,504.00	0.23
103	300750	宁德时代	800	427,840.00	0.22
104	002271	东方雨虹	7,340	406,048.80	0.21
105	601166	兴业银行	19,700	404,835.00	0.21
106	300763	锦浪科技	2,240	404,544.00	0.21
107	300677	英科医疗	3,192	398,361.60	0.21
108	300458	全志科技	4,500	394,470.00	0.21
109	600104	上汽集团	17,800	391,066.00	0.21
110	300223	北京君正	3,800	383,496.00	0.20
111	300383	光环新网	26,400	379,896.00	0.20
112	002567	唐人神	58,565	377,744.25	0.20
113	002106	莱宝高科	32,500	365,625.00	0.19
114	000157	中联重科	39,300	363,132.00	0.19
115	000933	神火股份	38,400	362,880.00	0.19
116	601607	上海医药	16,900	357,097.00	0.19
117	601600	中国铝业	67,200	356,160.00	0.19
118	600606	绿地控股	64,034	348,985.30	0.18
119	000661	长春高新	900	348,300.00	0.18
120	603899	晨光文具	4,000	338,240.00	0.18
121	002304	洋河股份	1,612	334,006.40	0.18
122	002758	浙农股份	35,300	333,938.00	0.18
123	601288	农业银行	106,000	321,180.00	0.17
124	601100	恒立液压	3,600	309,312.00	0.16
125	000671	阳光城	59,100	307,320.00	0.16
126	300244	迪安诊断	7,900	302,570.00	0.16
127	000401	冀东水泥	24,400	301,340.00	0.16
128	002352	顺丰控股	4,390	297,203.00	0.16
129	600803	新奥股份	17,900	295,529.00	0.16
130	603501	韦尔股份	900	289,800.00	0.15

131	300760	迈瑞医疗	602	288,990.10	0.15
132	000876	新希望	19,508	286,182.36	0.15
133	002463	沪电股份	18,000	278,460.00	0.15
134	002241	歌尔股份	6,499	277,767.26	0.15
135	000538	云南白药	2,400	277,728.00	0.15
136	601995	中金公司	4,500	276,750.00	0.15
137	603829	洛凯股份	25,500	275,400.00	0.14
138	600030	中信证券	9,600	239,424.00	0.13
139	603320	迪贝电气	19,500	220,740.00	0.12
140	300146	汤臣倍健	6,400	210,560.00	0.11
141	688680	海优新材	851	207,312.11	0.11
142	601138	工业富联	16,000	198,560.00	0.10
143	300736	百邦科技	17,000	189,720.00	0.10
144	600919	江苏银行	25,000	177,500.00	0.09
145	600258	首旅酒店	6,700	159,862.00	0.08
146	688981	中芯国际	2,572	159,001.04	0.08
147	601009	南京银行	14,855	156,274.60	0.08
148	600926	杭州银行	10,100	148,975.00	0.08
149	600741	华域汽车	5,600	147,112.00	0.08
150	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.07
151	600886	国投电力	14,300	137,423.00	0.07
152	601186	中国铁建	18,300	135,969.00	0.07
153	601088	中国神华	6,900	134,688.00	0.07
154	000686	东北证券	14,800	125,060.00	0.07
155	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.06
156	601601	中国太保	4,200	121,674.00	0.06
157	000002	万科 A	5,000	119,050.00	0.06
158	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.06
159	600028	中国石化	25,700	112,052.00	0.06
160	600588	用友网络	3,300	109,758.00	0.06
161	000060	中金岭南	24,000	108,480.00	0.06

162	002465	海格通信	11,000	104,060.00	0.05
163	300144	宋城演艺	6,100	102,480.00	0.05
164	600660	福耀玻璃	1,800	100,530.00	0.05
165	600183	生益科技	4,100	95,981.00	0.05
166	002812	恩捷股份	400	93,640.00	0.05
167	688079	美迪凯	5,052	92,956.80	0.05
168	002230	科大讯飞	1,300	87,854.00	0.05
169	300347	泰格医药	449	86,791.70	0.05
170	600438	通威股份	2,000	86,540.00	0.05
171	601633	长城汽车	1,900	82,821.00	0.04
172	601211	国泰君安	4,800	82,272.00	0.04
173	000776	广发证券	5,335	80,771.90	0.04
174	000063	中兴通讯	2,300	76,429.00	0.04
175	300601	康泰生物	500	74,500.00	0.04
176	002460	赣锋锂业	600	72,654.00	0.04
177	603799	华友钴业	600	68,520.00	0.04
178	601799	星宇股份	300	67,716.00	0.04
179	002129	中环股份	1,700	65,620.00	0.03
180	600161	天坛生物	1,900	65,075.00	0.03
181	600196	复星医药	900	64,917.00	0.03
182	002541	鸿路钢构	1,100	64,185.00	0.03
183	301018	申菱环境	7,673	63,609.17	0.03
184	600893	航发动力	1,100	58,509.00	0.03
185	002572	索菲亚	2,400	58,080.00	0.03
186	600958	东方证券	5,600	55,944.00	0.03
187	601901	方正证券	5,700	53,352.00	0.03
188	688355	明志科技	2,137	50,860.60	0.03
189	601111	中国国航	6,500	50,570.00	0.03
190	688663	新风光	2,623	50,387.83	0.03
191	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
192	002410	广联达	700	47,740.00	0.03

193	600643	爱建集团	6,770	47,254.60	0.02
194	601985	中国核电	9,300	47,058.00	0.02
195	601155	新城控股	1,100	45,760.00	0.02
196	603986	兆易创新	240	45,096.00	0.02
197	000625	长安汽车	1,700	44,676.00	0.02
198	601555	东吴证券	5,300	44,202.00	0.02
199	600377	宁沪高速	4,500	43,920.00	0.02
200	301020	密封科技	4,048	43,070.72	0.02
201	300753	爱朋医疗	1,900	42,978.00	0.02
202	300450	先导智能	700	42,098.00	0.02
203	000768	中航西飞	1,600	42,048.00	0.02
204	600346	恒力石化	1,600	41,984.00	0.02
205	688087	英科再生	1,802	39,571.92	0.02
206	002493	荣盛石化	2,250	38,857.50	0.02
207	601377	兴业证券	4,000	38,640.00	0.02
208	300726	宏达电子	539	37,994.11	0.02
209	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.02
210	300650	太龙照明	1,600	37,488.00	0.02
211	002821	凯莱英	100	37,260.00	0.02
212	002555	三七互娱	1,507	36,198.14	0.02
213	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
214	002601	龙麟佰利	1,000	34,580.00	0.02
215	300894	火星人	503	34,204.00	0.02
216	600426	华鲁恒升	1,100	34,045.00	0.02
217	600009	上海机场	700	33,691.00	0.02
218	002624	完美世界	1,400	33,474.00	0.02
219	600111	北方稀土	1,600	33,120.00	0.02
220	600988	赤峰黄金	2,200	32,978.00	0.02
221	600176	中国巨石	2,057	31,904.07	0.02
222	002001	新和成	1,111	31,863.48	0.02
223	000895	双汇发展	1,000	31,800.00	0.02

224	603806	福斯特	300	31,539.00	0.02
225	600755	厦门国贸	3,800	31,198.00	0.02
226	688608	恒玄科技	97	30,740.27	0.02
227	601877	正泰电器	900	30,042.00	0.02
228	600745	闻泰科技	300	29,070.00	0.02
229	603885	吉祥航空	1,900	28,994.00	0.02
230	688633	星球石墨	512	28,605.44	0.02
231	002371	北方华创	100	27,738.00	0.01
232	000963	华东医药	600	27,606.00	0.01
233	300957	贝泰妮	109	27,463.64	0.01
234	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
235	603659	璞泰来	200	27,320.00	0.01
236	600143	金发科技	1,300	27,118.00	0.01
237	603993	洛阳钼业	5,200	26,832.00	0.01
238	000425	徐工机械	4,100	26,117.00	0.01
239	300628	亿联网络	297	24,888.60	0.01
240	600085	同仁堂	600	24,510.00	0.01
241	600362	江西铜业	1,000	22,380.00	0.01
242	000069	华侨城 A	3,000	22,320.00	0.01
243	688036	传音控股	100	20,950.00	0.01
244	603886	元祖股份	1,200	20,916.00	0.01
245	300408	三环集团	463	19,640.46	0.01
246	000703	恒逸石化	1,600	19,120.00	0.01
247	000066	中国长城	1,300	18,980.00	0.01
248	688008	澜起科技	300	18,714.00	0.01
249	002044	美年健康	2,000	18,220.00	0.01
250	301015	N百洋	462	17,939.46	0.01
251	002602	世纪华通	2,700	17,334.00	0.01
252	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
253	300463	迈克生物	400	16,836.00	0.01
254	002008	大族激光	400	16,156.00	0.01

255	300953	震裕科技	161	16,075.85	0.01
256	600845	宝信软件	300	15,270.00	0.01
257	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
258	688665	四方光电	99	13,478.85	0.01
259	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
260	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
261	688023	安恒信息	51	12,852.00	0.01
262	300942	易瑞生物	446	12,723.49	0.01
263	300925	法本信息	474	12,461.46	0.01
264	603171	N税友	637	12,230.40	0.01
265	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
266	002916	深南电路	100	11,113.00	0.01
267	300741	华宝股份	200	10,144.00	0.01
268	300941	创识科技	203	10,137.82	0.01
269	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
270	300956	英力股份	356	9,184.80	0.00
271	301016	N雷尔伟	275	9,069.50	0.00
272	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
273	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
274	688788	科思科技	61	8,868.18	0.00
275	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
276	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
277	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
278	300961	深水海纳	368	8,121.76	0.00
279	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
280	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
281	300952	恒辉安防	284	7,690.72	0.00
282	688289	圣湘生物	76	7,558.20	0.00
283	688357	建龙微纳	65	7,146.75	0.00
284	688580	伟思医疗	40	6,700.00	0.00
285	002153	石基信息	280	6,582.80	0.00

286	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
287	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
288	603369	今世缘	100	5,416.00	0.00
289	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
290	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
291	002975	博杰股份	60	5,280.00	0.00
292	601857	中国石油	900	4,761.00	0.00
293	000783	长江证券	600	4,392.00	0.00
294	001979	招商蛇口	400	4,380.00	0.00
295	688298	东方生物	20	4,352.00	0.00
296	601319	中国人保	700	4,151.00	0.00
297	600637	东方明珠	500	4,095.00	0.00
298	688598	金博股份	15	4,035.00	0.00
299	000627	天茂集团	1,100	3,982.00	0.00
300	002920	德赛西威	36	3,962.88	0.00
301	688089	嘉必优	83	3,809.70	0.00
302	600208	新湖中宝	1,200	3,648.00	0.00
303	003816	中国广核	1,300	3,471.00	0.00
304	688555	泽达易盛	98	3,365.32	0.00
305	601198	东兴证券	300	3,279.00	0.00
306	688080	映翰通	65	3,095.30	0.00
307	688009	中国通号	541	3,078.29	0.00
308	601216	君正集团	600	3,054.00	0.00
309	600018	上港集团	600	2,862.00	0.00
310	600705	中航资本	700	2,709.00	0.00
311	600177	雅戈尔	400	2,636.00	0.00
312	002258	利尔化学	78	2,012.40	0.00
313	300003	乐普医疗	48	1,541.76	0.00
314	300418	昆仑万维	73	1,195.74	0.00
315	600928	西安银行	200	932.00	0.00
316	688588	凌志软件	46	833.98	0.00

317	688228	开普云	18	693.36	0.00
318	688656	浩欧博	8	594.96	0.00
319	002938	鹏鼎控股	10	358.80	0.00
320	688500	慧辰资讯	7	261.17	0.00
321	002443	金洲管道	18	113.40	0.00
322	000166	申万宏源	7	32.76	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	600036	招商银行	10,913,543.00	5.45
2	601318	中国平安	10,745,190.00	5.37
3	000333	美的集团	10,297,637.23	5.14
4	000858	五粮液	10,173,165.54	5.08
5	600031	三一重工	9,932,561.00	4.96
6	601888	中国中免	9,728,163.25	4.86
7	000568	泸州老窖	8,902,649.00	4.45
8	300059	东方财富	8,016,998.20	4.00
9	600519	贵州茅台	6,246,095.00	3.12
10	601668	中国建筑	6,186,015.00	3.09
11	002475	立讯精密	5,957,396.00	2.98
12	000661	长春高新	5,651,109.70	2.82
13	600030	中信证券	5,452,813.00	2.72
14	601899	紫金矿业	5,007,180.00	2.50
15	601012	隆基股份	4,876,636.00	2.44
16	601628	中国人寿	4,757,031.00	2.38
17	002271	东方雨虹	4,585,744.00	2.29
18	601919	中远海控	4,581,091.00	2.29
19	600809	山西汾酒	4,250,465.28	2.12

20	600522	中天科技	4,246,960.00	2.12
21	002142	宁波银行	4,113,747.00	2.05
22	002179	中航光电	4,085,292.04	2.04

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	601318	中国平安	14,598,445.00	7.29
2	600036	招商银行	13,437,498.00	6.71
3	000858	五粮液	10,794,511.86	5.39
4	601888	中国中免	10,044,419.39	5.02
5	000568	泸州老窖	9,950,316.61	4.97
6	002475	立讯精密	9,809,174.70	4.90
7	600031	三一重工	9,255,401.00	4.62
8	600519	贵州茅台	8,979,311.00	4.48
9	002271	东方雨虹	7,871,542.56	3.93
10	000661	长春高新	6,360,146.20	3.18
11	000333	美的集团	5,625,327.27	2.81
12	000338	潍柴动力	5,473,301.44	2.73
13	601012	隆基股份	5,336,380.00	2.67
14	002142	宁波银行	5,226,862.00	2.61
15	601155	新城控股	5,203,009.00	2.60
16	600030	中信证券	5,113,703.00	2.55
17	601668	中国建筑	4,999,821.00	2.50
18	601628	中国人寿	4,794,648.09	2.39
19	601211	国泰君安	4,783,006.00	2.39
20	601166	兴业银行	4,722,865.00	2.36
21	601919	中远海控	4,683,032.00	2.34
22	002831	裕同科技	4,675,026.08	2.33

23	600926	杭州银行	4,587,327.00	2.29
24	002714	牧原股份	4,470,166.29	2.23
25	600900	长江电力	4,252,798.00	2.12
26	601899	紫金矿业	4,198,038.46	2.10
27	000776	广发证券	4,181,919.85	2.09
28	601799	星宇股份	4,141,797.44	2.07

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	529,641,755.73
卖出股票收入（成交）总额	560,445,859.75

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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)	162,459.60	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	162,459.60	0.09

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	123111	东财转3	1,110	162,459.60	0.09

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招商银行（证券代码：600036.SH）因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等一系列情况，收到中国银行保险监督管理委员会罚款7170万元。除上述情况外，本基金投资的其他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。

本基金投资上述标的的投资决策程序为：

- 1、投资决策委员会确定每个产品的基本投资逻辑；
- 2、投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
- 3、基金经理拟订所管理产品的投资计划与方案；
- 4、金融工程小组对基金经理/投资经理的投资计划进行风险评价，并向投资决策委员会提交评估报告；
- 5、投资决策委员会对基金经理/投资经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；6、根据决策纪要，基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施；
- 7、中央交易室按有关交易规则执行基金经理/投资经理下达的交易指令，并将有关信息进行反馈；
- 8、基金经理/投资经理定期检讨投资组合的运作成效；
- 9、金融工程小组定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理/投资经理出具绩效与风险评估报告。

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	76,453.71
2	应收证券清算款	500,650.87
3	应收股利	-
4	应收利息	2,878.48
5	应收申购款	2,521.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	582,504.81
---	----	------------

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
391	284,236.34	103,842,868.29	93.44%	7,293,540.16	6.56%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	216,254.40	0.19%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年01月30日)基金份额总额	458,980,142.88
本报告期期初基金份额总额	130,005,334.85
本报告期基金总申购份额	21,215,738.99
减：本报告期基金总赎回份额	40,084,665.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	111,136,408.45

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人于2021年8月6日聘任吴林惠先生担任公司第四届董事会董事职务，原董事夏理芬先生于2021年8月6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、托管人涉及托管业务的部门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	
东北证券	2	178,258,890.82	16.50%	128,963.94	15.49%	-
广发证券	2	139,327,811.49	12.90%	100,611.23	12.08%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	99,808,653.00	9.24%	71,137.29	8.54%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	106,004,693.60	9.81%	75,401.53	9.06%	-
开源证券	2	190,240,146.10	17.61%	138,703.01	16.66%	-
申万宏源	2	59,980,501.69	5.55%	42,664.43	5.12%	-
天风证券	2	246,258,496.08	22.80%	228,621.20	27.46%	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	4	27,307,513.63	2.53%	19,778.15	2.38%	-
国金证券	4	15,154,029.32	1.40%	13,890.55	1.67%	-

财通 证券	5	17,823,954.67	1.65%	12,852.27	1.54%	-
----------	---	---------------	-------	-----------	-------	---

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。

10.8 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部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
2	《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金2020年第4季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
3	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-26
4	《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-28
5	《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-24
6	《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-02

7	《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-09
8	《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-27
9	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国金理益财富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	2021-04-02
10	《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-03
11	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波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	2021-04-10
12	《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
13	《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-30
14	《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合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	2021-05-12
15	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大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	2021-05-14
16	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为代销机构并参加基	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18

	《金申购费率优惠活动的公告》		
17	《财通基金管理有限公司关于根据〈公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）〉修订旗下部分公募基金基金合同的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-26
18	《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年6月26日公告）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-26
19	《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同（2021年6月26日公告）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-26
20	《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议（2021年6月26日公告）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-26

§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	2021-02-04 至 2021-06-30	19,999,000.00	0.00	0.00	19,999,000.00	18.00%
机构	2	2020-09-11 至 2021-06-30	65,126,999.06	0.00	0.00	65,126,999.06	58.60%

产品特有风险

本基金作为混合型基金，在基金投资中对股票和债券类资产进行积极配置，并精选优质个股和券种，构建投资组合。在具体投资管理中可能会在大类资产配置、股票行业配置比例等环节形成误判而导致基金财产损失。本基金可以投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。本基金的投资范围包括存托凭证，面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。

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、财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金托管协议；
- 4、财通量化价值优选灵活配置混合型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
二〇二一年八月二十八日