

财通价值动量混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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:2023 年 08 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29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2023年1月1日起至2023年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	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	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	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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	57
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	57
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	57

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12	投资组合报告附注	57
§8	基金份额持有人信息	59
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§9	开放式基金份额变动	59
§10	重大事件揭示	60
10.1	基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4	基金投资策略的改变	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8	其他重大事件	66
§11	影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	68
§12	备查文件目录	68
12.1	备查文件目录	68
12.2	存放地点	68
12.3	查阅方式	68

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通价值动量混合型证券投资基金
基金简称	财通价值动量混合
场内简称	-
基金主代码	720001
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月01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	608,889,860.16份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以价值投资为基础，辅以对市场运行规律的研判，动态调整投资组合，在严格控制风险并充分保证流动性的前提下，力求获取超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金的资产配置策略为以评估不同投资品种的整体投资价值进行战略资产配置，以动量特征为依据进行战术资产配置；个股投资策略充分贯彻“价值投资为基础，动量策略为辅助”的投资理念，分别在行业配置和个股精选两个层面进行基本面情况、估值以及动量效应的研究，挖掘出具有估值优势和动量效应的个股并构建股票投资组合；通过综合运用久期管理策略、收益率曲线策略、类属配置策略、套利和时机选择策略等组合管理手段进行固定收益证券投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60% + 上证国债指数收益率×40%
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、中高预期收益的基金产品。
--	----------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	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		021-68888169	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		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45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		吴林惠	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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	财通基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45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 (2023年01月01日 - 2023年06月30日)
本期已实现收益	-340,926,723.09
本期利润	-226,281,713.73
加权平均基金份额本期利润	-0.3081
本期加权平均净值利润率	-7.32%
本期基金份额净值增长率	-8.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	1,140,643,797.76
期末可供分配基金份额利润	1.8733
期末基金资产净值	2,367,518,768.43
期末基金份额净值	3.888
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	414.27%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	-6.04%	3.00%	0.88%	0.52%	-6.92%	2.48%
过去三个月	-9.79%	2.68%	-2.53%	0.49%	-7.26%	2.19%
过去六个月	-8.67%	1.99%	0.50%	0.51%	-9.17%	1.48%
过去一年	-20.46%	1.77%	-7.25%	0.59%	-13.21%	1.18%
过去三年	16.03%	1.97%	0.67%	0.72%	15.36%	1.25%
自基金合同生效起至今	414.27%	1.73%	63.99%	0.84%	350.28%	0.89%

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×60% + 上证国债指数收益率×40%。

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

财通价值动量混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：(1)本基金合同生效日为2011年12月1日；

(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截至报告期末和基金建仓期末，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。

截至2023年6月30日，公司员工共计228人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在13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		
金梓才	公司总经理助理、权益投资总监、基金投资部总经理、本基金的基金经理	2014-11-19	-	13年	上海交通大学微电子学硕士。历任华泰资产管理有限公司投资经理助理，信诚基金管理有限公司TMT行业高级研究员。2014年8月加入财通基金管理有限公司，曾任基金投资部基金经理、副总监、副总监（主持工作）、总监，现任公司总经理助理、权益

					投资总监、基金投资部总 经理、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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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管理制度》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

2023年二季度，我们继续对AI各个板块做了较高比例配置。我们意识到ChatGPT的横空出世让世界看到了通用大语言模型的巨大进步，未来可能会深刻改变我们的生活。投资机会主要集中在算力相关、数据要素、应用等几个行业上，故我们做了相应增配，我们认为未来TMT板块的投资机会变化会很快，产业机会较多，我们会持续重点关注。特别的，站在二季度末当下，我们认为市场对算力的预期已经较为充分，我们预计算力板块后续可能会开始分化；但在海外，AI相关应用已经蓬勃发展，因处在产业初期，市场还看的不太清晰，不敢给予过高估值。在现阶段，我们相对更看好应用相关细分方向投资机会，to B端和to C端应用或将都会有所涉及。在标的选择上，我们更关注有场景和用户的上市公司。

2023年可能是基本面快速变化的一年，变化集中在成长股各个方向的产业趋势上，未来可能我们的调仓频率会加快，以适应快速变化的产业状态。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通价值动量混合基金份额净值为3.888元，本报告期内，基金份额净值增长率为-8.67%，同期业绩比较基准收益率为0.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年下半年，我们认为随着稳增长的措施出台，经济下行较快阶段大概率已经过去。我们认为目前的宏观环境和18年下半年颇为相似，只是经济复苏的难度大于当时，各种长期因素的制约大概率影响顺周期反弹的高度。

同时，我们也看到政府对资本市场开始高度重视，我们认为未来资本市场交易会日趋活跃，但同时经济复苏难度较大且面临局面复杂，大概率市场风格将重新聚焦在成长各个方向上。

确实在目前的宏观背景下，流动性愈发宽松叠加经济恢复预期偏弱以及资本市场重新被重视的预期，较有可能产生一轮不小级别的牛市，且偏向小市值和成长风格，市场总体风险偏好将较高。我们在持仓上可能会偏向于产业趋势明确、想象空间较大的成长品种。

我们将继续坚持以产业研究为基础，追求投资的可复制性、可跟踪性和前瞻性，在符合产业趋势的正确赛道上，力求投资较为优秀的公司，并保持密切跟踪，根据公司基本面的动态变化来做持仓的调整，在优质公司上做好大的波段，力争为投资者获取持续的超额回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票指数的通知》《关于固定收益品种的估值处理标准》《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和《资产管理产品相关会计处理规定》等法律法规、自律规则等设立公司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、投研部门分管领导、基金清算部门分管领导、基金投资部、专户投资部、固收投资部、量化投资部、研究部、风险管理部、法律合规部、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、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。如果基金经理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、确定调整/暂停估值方案，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》，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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%；

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——财通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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本基金2023年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：财通价值动量混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	332,298,110.42	693,342,990.25
结算备付金		5,608,047.22	3,311,675.18
存出保证金		1,331,680.49	1,154,368.63
交易性金融资产	6.4.7.2	2,021,958,747.21	2,889,900,535.55
其中：股票投资		1,885,964,612.74	2,889,900,535.55
基金投资		-	-
债券投资		135,994,134.47	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		21,326,564.14	54,536,524.05
应收股利		-	-
应收申购款		3,128,218.68	3,487,848.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,385,651,368.16	3,645,733,942.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,184,090.84	-
应付赎回款		590,278.77	2,063,874.50
应付管理人报酬		3,271,350.60	4,599,995.72
应付托管费		545,225.09	766,665.92
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,964.86	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	6,538,689.57	4,262,908.66
负债合计		18,132,599.73	11,693,444.80
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	608,889,860.16	853,625,364.93
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,758,628,908.27	2,780,415,132.84
净资产合计		2,367,518,768.43	3,634,040,497.77
负债和净资产总计		2,385,651,368.16	3,645,733,942.57

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值3.888元，基金份额总额608,889,860.16份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通价值动量混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-199,211,669.44	128,596,428.91
1.利息收入		1,049,490.18	615,232.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,049,490.18	615,232.20

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）		-316,600,215.73	-65,537,683.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-351,691,075.66	-62,087,422.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	25,361,655.75	-6,463,619.72
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	9,729,204.18	3,013,358.97
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	114,645,009.36	189,766,747.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,694,046.75	3,752,132.24
<b>减：二、营业总支出</b>		27,070,044.29	33,607,800.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,085,538.42	28,696,101.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,847,589.82	4,782,683.68
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-



5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		968.08	1,919.08
8. 其他费用	6.4.7.17	135,947.97	127,095.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-226,281,713.73	94,988,628.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-226,281,713.73	94,988,628.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-226,281,713.73	94,988,628.41

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：财通价值动量混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	853,625,364.93	-	2,780,415,132.84	3,634,040,497.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	853,625,364.93	-	2,780,415,132.84	3,634,040,497.77

值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-244,735,504.77	-	-1,021,786,224.57	-1,266,521,729.34
(一)、综合收益总额	-	-	-226,281,713.73	-226,281,713.73
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-244,735,504.77	-	-795,504,510.84	-1,040,240,015.61
其中：1.基金申购款	118,835,950.90	-	379,223,265.73	498,059,216.63
2.基金赎回款	-363,571,455.67	-	-1,174,727,776.57	-1,538,299,232.24
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	608,889,860.16	-	1,758,628,908.27	2,367,518,768.43
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	609,645,770.09	-	2,286,228,089.89	2,895,873,859.98

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	609,645,770.09	-	2,286,228,089.89	2,895,873,859.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	328,144,615.39	-	1,359,533,130.95	1,687,677,746.34
（一）、综合收益总额	-	-	94,988,628.41	94,988,628.41
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	328,144,615.39	-	1,264,544,502.54	1,592,689,117.93
其中：1.基金申购款	853,820,927.32	-	3,274,391,015.49	4,128,211,942.81
2.基金赎回款	-525,676,311.93	-	-2,009,846,512.95	-2,535,522,824.88
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	937,790,385.48	-	3,645,761,220.84	4,583,551,606.32

值)				
----	--	--	--	--

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:

徐春庭

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

财通价值动量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[2011]1476号文《关于核准财通价值动量混合型证券投资基金募集的批复》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人募集，基金合同于2011年12月1日正式生效，首次设立募集规模为1,058,572,878.12份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定）。如法律法规或监管机构未来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。

股票资产（含存托凭证）占基金资产的30%-80%，其中投资于价值公司股票池内的个股不少于股票资产的80%；债券、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的0%-65%，其中权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%；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。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报

表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023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

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 6.4.6.3 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法》、《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发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 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。

#### 6.4.6.5 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 2023年06月30日
活期存款	332,298,110.42
等于：本金	332,262,854.08
加：应计利息	35,256.34
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	332,298,110.42

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,886,777,743.34	-	1,885,964,612.74	-813,130.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	659,145.32	135,994,134.47	-3,169,756.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	659,145.32	135,994,134.47	-3,169,756.40
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,025,282,488.89	659,145.32	2,021,958,747.21	-3,982,887.00

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末	
	2023年06月30日	
应付券商交易单元保证金	500,000.00	
应付赎回费	1,616.68	
应付证券出借违约金	-	
应付交易费用	5,639,124.92	
其中：交易所市场	5,639,124.92	
银行间市场	-	
应付利息	-	
预提费用	397,947.97	
合计	6,538,689.57	

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	853,625,364.93	853,625,364.93
本期申购	118,835,950.90	118,835,950.90
本期赎回（以“-”号填列）	-363,571,455.67	-363,571,455.67
本期末	608,889,860.16	608,889,860.16

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。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,984,618,256.68	795,796,876.16	2,780,415,132.84
本期利润	-340,926,723.09	114,645,009.36	-226,281,713.73
本期基金份额交易产生的变动数	-503,047,735.83	-292,456,775.01	-795,504,510.84
其中：基金申购款	243,615,946.88	135,607,318.85	379,223,265.73
基金赎回款	-746,663,682.71	-428,064,093.86	-1,174,727,776.57

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,140,643,797.76	617,985,110.51	1,758,628,908.27

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入	957,925.94	
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	77,844.33	
其他	13,719.91	
合计	1,049,490.18	

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
卖出股票成交总额	8,180,595,109.06	
减：卖出股票成本总额	8,510,804,134.91	
减：交易费用	21,482,049.81	
买卖股票差价收入	-351,691,075.66	

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
债券投资收益——利息收入	268,925.70	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	25,092,730.05	

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	25,361,655.75

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	276,086,304.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	250,570,089.87
减：应计利息总额	396,836.34
减：交易费用	26,648.73
买卖债券差价收入	25,092,730.05

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 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。

##### 6.4.7.12.2 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。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	9,729,204.18
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	9,729,204.18

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	114,645,009.36
——股票投资	117,814,765.76
——债券投资	-3,169,756.40
——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	114,645,009.36

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	1,692,407.90
转换费收入	1,638.85
合计	1,694,046.75

**6.4.7.16 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	26,852.03
合计	135,947.97

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无其他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、注册登记机构、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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	1,076,423,472.56	6.92%	0.00	0.00%

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
财通证券	54,292,250.01	8.15%	0.00	0.00%

#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比例		额的比例
财通证券	991,712.51	8.21%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,085,538.42	28,696,101.80
其中：支付销售机构的客户维护费	6,700,585.86	8,130,830.34

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,847,589.82	4,782,683.68

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况  
无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况  
无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	332,298,110.42	957,925.94	255,932,691.48	525,702.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。



#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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。

##### 6.4.10.8.2 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——固定净值型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（2023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	受限期	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
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内（含）	认购新发证券	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内（含）	认购新发证券	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
688443	智翔金泰	2023-06-1	6个月	新股限售	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-

		3								
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新股限售	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	认购新发证券	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内(含)	认购新发证券	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	新股限售	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股限售	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股限售	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-31	6个月	新股限售	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-

		0								
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6个月	新股限售	165.92	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	122.11	72	-	8,791.92	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股限售	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	新股限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	新股限售	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
301439	泓淋电力	2023-03-1	6个月	新股限售	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-

		0								
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	1,111	16,453.91	15,254.03	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	新股限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	新股限售	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	新股限售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	新股限售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	新股限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-

603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股限售	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新股限售	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	新股限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	新股限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
3012	科源	2023	6个月	新股	31.50	25.10	241	10,64	6,04	-

81	制药	-03-28		限售				7.38	9.10	
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	25.10	97	-	2,434.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股限售	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股限售	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
0013	长青	2023	6个月	新股	18.88	19.60	114	2,15	2,23	-

24	科技	-05-12		限售				2.32	4.40	
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

#### 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。公司经营管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，经营管理层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，公司设独立的法律合规部和风险管理部，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行中国工商银行，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、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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 2023 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	332,298,110.42	-	-	-	-	-	332,298,110.42
结算备付	5,608,047.22	-	-	-	-	-	5,608,047.22

金							
存出 保证金	1,331,680.49	-	-	-	-	-	1,331,680.49
交易 性金 融资 产	-	-	-	135,993,254.45	880.02	1,885,964,612.74	2,021,958,747.21
应收 清算 款	-	-	-	-	-	21,326,564.14	21,326,564.14
应收 申购 款	47,478.35	-	-	-	-	3,080,740.33	3,128,218.68
资产 总计	339,285,316.48	-	-	135,993,254.45	880.02	1,910,371,917.21	2,385,651,368.16
负债							
应付 清算 款	-	-	-	-	-	7,184,090.84	7,184,090.84
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	590,278.77	590,278.77
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	3,271,350.60	3,271,350.60
应付 托管 费	-	-	-	-	-	545,225.09	545,225.09
应交 税费	-	-	-	-	-	2,964.86	2,964.86
其他 负债	-	-	-	-	-	6,538,689.57	6,538,689.57
负债 总计	-	-	-	-	-	18,132,599.73	18,132,599.73
利率 敏感 度缺 口	339,285,316.48	-	-	135,993,254.45	880.02	1,892,239,317.48	2,367,518,768.43

上年度末 2022 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	693,342,99 0.25	-	-	-	-	-	693,342,990.2 5
结算 备付 金	3,311,675.1 8	-	-	-	-	-	3,311,675.18
存出 保证 金	1,154,368.6 3	-	-	-	-	-	1,154,368.63
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	2,889,900,53 5.55	2,889,900,53 5.55
应收 清算 款	-	-	-	-	-	54,536,524.05	54,536,524.05
应收 申购 款	6,163.03	-	-	-	-	3,481,685.88	3,487,848.91
资产 总计	697,815,19 7.09	-	-	-	-	2,947,918,74 5.48	3,645,733,94 2.57
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	2,063,874.50	2,063,874.50
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	4,599,995.72	4,599,995.72
应付 托管 费	-	-	-	-	-	766,665.92	766,665.92
其他 负债	-	-	-	-	-	4,262,908.66	4,262,908.66

负债总计	-	-	-	-	-	11,693,444.80	11,693,444.80
利率敏感度缺口	697,815,19 7.09	-	-	-	-	2,936,225,30 0.68	3,634,040,49 7.77

注：表中所示为本基金资产负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 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均未持有交易性固定收益类投资（不含可转债及可交换债券）。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，股票资产（含存托凭证）占基金资产的30%-80%，其中投资于价值公司股票池内的个股不少于股票资产的80%；债券、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的0%-65%，其中权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%；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。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 2023年06月30日		上年度末 2022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	1,885,964,612.74	79.66	2,889,900,535.55	79.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	135,994,134.47	5.74	-	-
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	2,021,958,747.21	85.40	2,889,900,535.55	79.52

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准增加1%	20,246,462.13	39,695,073.44

	业绩比较基准减少1%	-20,246,462.13	-39,695,073.44
--	------------	----------------	----------------

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	2,020,124,797.89	2,888,668,723.35
第二层次	423,888.14	-
第三层次	1,410,061.18	1,231,812.20
合计	2,021,958,747.21	2,889,900,535.55

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 1、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2、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	1,885,964,612.74	79.05
	其中：股票	1,885,964,612.74	79.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	135,994,134.47	5.70
	其中：债券	135,994,134.47	5.70
	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	337,906,157.64	14.16
8	其他各项资产	25,786,463.31	1.08
9	合计	2,385,651,368.16	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	1,390.80	0.00
C	制造业	82,332,913.06	3.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,600.03	0.00

E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	38,587.92	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	17,176.07	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,321,057,177.26	55.80
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	101,096,558.63	4.27
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	381,328,515.48	16.11
S	综合	-	-
	合计	1,885,964,612.74	79.66

### 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	688095	福昕软件	1,772,240	223,975,691.20	9.46
2	603533	掌阅科技	5,825,500	161,482,860.00	6.82
3	300364	中文在线	7,705,800	137,317,356.00	5.80
4	002605	姚记科技	2,563,200	119,009,376.00	5.03
5	601900	南方传媒	5,461,100	112,007,161.00	4.73
6	688590	新致软件	4,462,165	101,425,010.45	4.28



7	300280	紫天科技	2,116,319	101,096,558.63	4.27
8	300654	世纪天鸿	7,602,229	99,741,244.48	4.21
9	688369	致远互联	1,794,068	99,211,960.40	4.19
10	002558	巨人网络	5,479,900	98,254,607.00	4.15
11	002517	恺英网络	5,919,000	93,165,060.00	3.94
12	300148	天舟文化	16,408,900	90,577,128.00	3.83
13	300559	佳发教育	5,353,400	88,331,100.00	3.73
14	300002	神州泰岳	6,277,169	87,880,366.00	3.71
15	002315	焦点科技	2,113,015	84,520,600.00	3.57
16	000977	浪潮信息	1,643,400	79,704,900.00	3.37
17	300288	朗玛信息	3,768,000	73,023,840.00	3.08
18	002343	慈文传媒	4,256,300	32,262,754.00	1.36
19	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.02
20	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
21	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
22	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
23	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
24	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
25	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
26	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
27	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
28	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
29	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
30	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
31	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
32	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
33	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
34	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
35	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
36	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
37	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00

38	001311	多利科技	649	37,272.07	0.00
39	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
40	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
41	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
42	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
43	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
44	301327	华宝新能	315	24,919.65	0.00
45	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
46	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
47	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
48	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
49	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
50	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
51	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
52	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
53	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
54	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
55	301332	德尔玛	1,111	15,254.03	0.00
56	301280	珠城科技	419	14,983.44	0.00
57	301121	紫建电子	290	14,685.60	0.00
58	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
59	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
60	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
61	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
62	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
63	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
64	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
65	301282	金禄电子	434	13,046.04	0.00
66	301277	新天地	659	12,857.09	0.00
67	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
68	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00

69	301137	哈焊华通	644	11,508.28	0.00
70	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
71	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
72	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
73	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
74	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
75	603073	彩蝶实业	530	11,055.80	0.00
76	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
77	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
78	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
79	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
80	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
81	301110	青木股份	202	10,186.86	0.00
82	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
83	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
84	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
85	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
86	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
87	301176	逸豪新材	544	9,345.92	0.00
88	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
89	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
90	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
91	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
92	001238	浙江正特	374	8,800.22	0.00
93	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
94	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
95	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
96	603291	联合水务	536	8,152.56	0.00
97	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
98	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
99	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00

100	301237	和顺科技	261	7,749.09	0.00
101	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
102	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
103	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00
104	601022	宁波远洋	383	3,979.37	0.00
105	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
106	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
107	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
108	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
109	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
110	002155	湖南黄金	114	1,390.80	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	000568	泸州老窖	287,702,090.04	7.92
2	601689	拓普集团	199,569,681.06	5.49
3	603179	新泉股份	198,607,074.73	5.47
4	603305	旭升集团	193,625,016.80	5.33
5	300498	温氏股份	189,629,852.63	5.22
6	000539	粤电力 A	189,522,998.68	5.22
7	688095	福昕软件	186,013,653.79	5.12
8	603986	兆易创新	173,138,720.69	4.76
9	002100	天康生物	162,201,889.22	4.46
10	600519	贵州茅台	160,968,459.37	4.43
11	002567	唐人神	156,196,871.09	4.30
12	300223	北京君正	155,980,475.78	4.29
13	300364	中文在线	151,835,041.50	4.18
14	000021	深科技	150,216,267.25	4.13

15	603533	掌阅科技	146,392,060.77	4.03
16	300474	景嘉微	145,091,501.61	3.99
17	300036	超图软件	135,529,155.25	3.73
18	002155	湖南黄金	134,510,361.84	3.70
19	600011	华能国际	133,834,338.84	3.68
20	600667	太极实业	133,530,837.78	3.67
21	002919	名臣健康	133,169,736.40	3.66
22	002304	洋河股份	132,618,193.64	3.65
23	300059	东方财富	131,461,236.21	3.62
24	300299	富春股份	130,319,734.65	3.59
25	688088	虹软科技	124,044,454.63	3.41
26	601991	大唐发电	121,884,766.60	3.35
27	600027	华电国际	120,782,698.00	3.32
28	601360	三六零	120,522,105.94	3.32
29	600373	中文传媒	119,445,939.09	3.29
30	300418	昆仑万维	118,973,297.06	3.27
31	601928	凤凰传媒	118,072,501.28	3.25
32	300280	紫天科技	117,372,770.59	3.23
33	601900	南方传媒	114,830,439.18	3.16
34	601595	上海电影	114,737,061.19	3.16
35	002605	姚记科技	113,447,768.00	3.12
36	688590	新致软件	111,644,129.74	3.07
37	688369	致远互联	109,735,575.73	3.02
38	688256	寒武纪	107,754,123.98	2.97
39	688475	萤石网络	106,184,244.57	2.92
40	002624	完美世界	101,611,416.92	2.80
41	002517	恺英网络	100,399,962.92	2.76
42	605108	同庆楼	99,783,127.65	2.75
43	000799	酒鬼酒	99,752,166.09	2.74
44	002558	巨人网络	96,293,437.87	2.65
45	002315	焦点科技	94,204,260.79	2.59

46	688111	金山办公	93,026,924.27	2.56
47	300148	天舟文化	92,461,239.68	2.54
48	000977	浪潮信息	88,591,297.78	2.44
49	300559	佳发教育	88,129,768.84	2.43
50	300002	神州泰岳	87,570,331.04	2.41
51	300654	世纪天鸿	83,738,456.75	2.30
52	301060	兰卫医学	80,583,621.81	2.22
53	300288	朗玛信息	79,063,233.08	2.18
54	002343	慈文传媒	77,409,918.40	2.13

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	600011	华能国际	411,368,759.78	11.32
2	000539	粤电力 A	383,774,988.55	10.56
3	600027	华电国际	357,329,646.90	9.83
4	601991	大唐发电	341,977,823.63	9.41
5	000568	泸州老窖	285,257,357.20	7.85
6	603283	赛腾股份	194,859,155.33	5.36
7	600875	东方电气	191,372,294.04	5.27
8	300498	温氏股份	183,205,826.31	5.04
9	603179	新泉股份	182,650,649.12	5.03
10	000021	深科技	177,274,761.58	4.88
11	603305	旭升集团	173,508,503.44	4.77
12	601689	拓普集团	171,832,709.46	4.73
13	301073	君亭酒店	170,378,065.90	4.69
14	002100	天康生物	163,816,793.36	4.51
15	002567	唐人神	158,761,123.34	4.37
16	601595	上海电影	156,475,374.40	4.31

17	600519	贵州茅台	155,941,715.74	4.29
18	000543	皖能电力	151,888,601.51	4.18
19	002155	湖南黄金	151,201,145.87	4.16
20	600138	中青旅	148,007,293.73	4.07
21	002919	名臣健康	146,974,067.80	4.04
22	603986	兆易创新	144,582,954.85	3.98
23	688617	惠泰医疗	135,490,691.01	3.73
24	601360	三六零	133,046,739.01	3.66
25	600754	锦江酒店	132,315,363.36	3.64
26	002033	丽江股份	131,756,514.16	3.63
27	002304	洋河股份	128,407,748.52	3.53
28	300624	万兴科技	128,272,823.34	3.53
29	603136	天目湖	127,288,120.61	3.50
30	300059	东方财富	125,759,426.93	3.46
31	688088	虹软科技	120,675,211.19	3.32
32	688351	微电生理	120,665,647.97	3.32
33	300223	北京君正	117,824,124.20	3.24
34	300418	昆仑万维	117,308,299.62	3.23
35	300036	超图软件	116,983,602.76	3.22
36	600667	太极实业	112,659,163.62	3.10
37	688111	金山办公	106,420,206.86	2.93
38	300474	景嘉微	103,272,355.04	2.84
39	600373	中文传媒	101,930,395.90	2.80
40	605108	同庆楼	101,854,146.12	2.80
41	601928	凤凰传媒	101,853,682.77	2.80
42	688501	青达环保	97,894,695.79	2.69
43	601007	金陵饭店	97,507,357.40	2.68
44	688475	萤石网络	97,028,830.60	2.67
45	000799	酒鬼酒	96,640,003.58	2.66
46	300314	戴维医疗	96,504,170.56	2.66
47	688256	寒武纪	92,269,857.90	2.54

48	600258	首旅酒店	92,222,203.52	2.54
49	002624	完美世界	90,903,819.31	2.50
50	300299	富春股份	88,644,016.81	2.44
51	688278	特宝生物	80,843,974.08	2.22

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	7,389,053,446.34
卖出股票收入（成交）总额	8,180,595,109.06

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)	135,994,134.47	5.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	135,994,134.47	5.74

### 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	128074	游族转债	508,100	72,355,388.88	3.06
2	123109	昌红转债	369,002	42,748,679.51	1.81
3	110062	烽火转债	167,430	20,889,186.06	0.88
4	123176	精测转2	5	880.02	0.00

#### 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投资贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂不投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

#### 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南方传媒（证券代码：601900.SH）发行主体南方出版传媒股份有限公司子公司广东时代传媒集团有限公司因涉嫌传播虚假信息被证监会立案调查。

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：

- （一）投资决策委员会确定产品的基本投资逻辑；
- （二）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；
- （三）基金经理/投资经理拟订所管理产品的投资计划与方案；

(四) 风险管理部对各投资组合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;

(五) 投资决策委员会审议基金经理/投资经理提交的议案, 并形成决议;

(六) 根据决议, 基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施;

(七) 集中交易部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;

(八) 基金经理/投资经理定期汇报投资组合的运作成效;

(九) 风险管理部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	1,331,680.49
2	应收清算款	21,326,564.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,128,218.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,786,463.31

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位: 人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128074	游族转债	72,355,388.88	3.06
2	123109	昌红转债	42,748,679.51	1.81
3	110062	烽火转债	20,889,186.06	0.88

### 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的股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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
129,357	4,707.05	163,504,429.56	26.8529%	445,385,430.60	73.1471%

### 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	1,033,144.71	0.1697%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年12月01日)基金份额总额	1,058,572,878.12
本报告期期初基金份额总额	853,625,364.93
本报告期基金总申购份额	118,835,950.90

减：本报告期基金总赎回份额	363,571,455.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	608,889,860.16

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、本报告期内，本基金管理人于2023年6月1日聘任吴明建先生担任公司副总经理职务，吴明建先生现任公司副总经理、财务负责人职务。

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

本报告期内本基金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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	402,555,614.74	2.59%	290,364.21	2.40%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	1,076,423,472.56	6.92%	991,712.51	8.21%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	274,695,463.47	1.77%	200,886.48	1.66%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	337,894,688.86	2.17%	247,098.16	2.05%	-
东方财富证券股份有限公司	2	527,214,088.45	3.39%	385,557.57	3.19%	-
东方证券	2	32,766,078.34	0.21%	23,962.16	0.20%	-
东海证券	2	-	-	-	-	-

方正证券	2	213,060,052.32	1.37%	153,679.82	1.27%	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	1,668,073,218.39	10.72%	1,549,370.92	12.83%	-
国海证券	2	31,698,720.58	0.20%	23,181.36	0.19%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	935,947,290.72	6.02%	682,528.05	5.65%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	197,140,942.40	1.27%	183,596.00	1.52%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	1,561,804,078.24	10.04%	1,133,058.07	9.38%	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	2,906,996,455.36	18.69%	2,116,190.96	17.52%	-

民族证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	1,041,576,830.01	6.70%	756,631.43	6.27%	-
申银万国	2	916,974,032.94	5.89%	853,980.14	7.07%	-
太平洋证券	2	85,686,863.64	0.55%	62,659.56	0.52%	-
天风证券	2	25,784,342.00	0.17%	23,755.10	0.20%	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	130,467,317.31	0.84%	94,106.87	0.78%	-
兴业证券	2	113,375.91	0.00%	81.77	0.00%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	1,297,851,688.47	8.34%	936,139.14	7.75%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-

安信 证券	4	1,163,096,380.40	7.48%	842,275.59	6.97%	-
中信 建投 证券	4	727,939,034.94	4.68%	525,604.69	4.35%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	48,241,680.20	7.24%	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	54,292,250.01	8.15%	-	-	-	-	-	-



长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	36,062,254.20	5.42%	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	58,230,599.19	8.74%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	97,467,668.21	14.64%	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	205,977,941.50	30.93%	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	94,314,702.38	14.16%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	71,353,033.28	10.71%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2023倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-04
2	财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-04
3	财通基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-18
4	财通价值动量混合型证券投资基金2022年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-21
5	财通基金管理有限公司分支机构负责人任职公告	中国证监会规定媒介	2023-02-04
6	关于上海爱建基金销售有限公司终止代理销售财通基金	中国证监会规定媒介	2023-03-22

	管理有限公司旗下基金的公告		
7	财通价值动量混合型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-30
8	财通基金管理有限公司关于设立浙江分公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-06
9	财通价值动量混合型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-22
10	财通基金管理有限公司关于成都分公司经营范围变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-27
11	财通基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-05
12	关于江西正融基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-20
13	财通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-02
14	财通基金管理有限公司关于旗下基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-06-30
15	财通价值动量混合型证券投资基金更新招募说明书（2023年06月30日公告）	中国证监会规定媒介	2023-06-30
16	财通价值动量混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2023年06月30日公告）	中国证监会规定媒介	2023-06-30

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、财通价值动量混合型证券投资基金基金合同；
- 3、财通价值动量混合型证券投资基金托管协议；
- 4、财通价值动量混合型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

### 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43/45楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：[www.ctfund.com](http://www.ctfund.com)

财通基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日