

**财通可持续发展主题混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告**

**2020 年 12 月 31 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**

**报告送出日期:2021 年 01 月 21 日**

## §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责任。

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2021年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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2020年10月1日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	财通可持续混合
场内简称	-
基金主代码	000017
交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2013年03月27日
报告期末基金份额总额	471,062,112.18份
投资目标	本基金在可持续发展的投资理念下，通过系统化评估方法精选出可持续发展特征突出的上市公司进入投资视野，并选择具有估值优势的股票进行实际投资，在有效控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金采用定性与定量分析相结合的方法，通过对货币、债券和股票市场的整体估值状况比较分析，进行资产配置及组合的构建；行业配置策略上，根据宏观经济周期、行业生命周期、行业结构升级、宏观和产业政策等的变化情况，投资时钟理论，货币和财政政策的变化对行业的影响，结合行业自身估值水平，借助数量化方法筛选出预期能够获得超额收益的行业。

	本基金以企业的可持续发展特征评估为股票选择的基础,以企业的综合性成长评估为股票选择的增强因素,精选具有估值优势的个股;在保证资产流动性的基础上,债券投资采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法;权证投资以价值分析为基础,采用数量化模型分析其合理定价,结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标,选择买入和卖出时机;在股指期货投资中根据风险管理原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下参与投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80% +上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只主动型混合基金,属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,预期风险与预期收益均高于债券型基金及货币市场基金。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2020年10月01日 - 2020年12月31日)
1.本期已实现收益	63,346,259.67
2.本期利润	138,534,895.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.2503
4.期末基金资产净值	1,032,826,154.37
5.期末基金份额净值	2.193

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。

#### 3.2 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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.02%	1.24%	10.88%	0.79%	4.14%	0.45%
过去六个月	30.99%	1.50%	20.06%	1.08%	10.93%	0.42%
过去一年	72.45%	1.74%	22.61%	1.14%	49.84%	0.60%
过去三年	105.33%	1.49%	27.50%	1.07%	77.83%	0.42%
过去五年	89.13%	1.41%	37.37%	1.00%	51.76%	0.41%
自基金合同生效起至今	416.22%	1.54%	92.76%	1.18%	323.46%	0.36%

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)本基金选择沪深300指数作为股票投资部分的业绩基准，选择上证国债指数作为债券投资部分的业绩基准，复合业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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2013年3月27日；

(2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月，截至建仓期末和本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

(3) 根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，并经与基金托管人协商一致，本基金类型自2015年1月5日起由股票型变更为混合型，其基金名称变更为“财通可持续发展主题混合型证券投资基金”，对应基金简称变更为“财通可持续混合”。具体信息详见基金管理人发布的相关公告。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏钦	本基金的基金经理	2016年5月11日	-	13年	上海交通大学会计学硕士。历任上海申银万国证券研究所高级研究员、UBS(瑞银)董事、平安资产管理有限责任公司策略研究经理，2015年9月加入财通基金管理有限公司，现任基金投资部基金经理。

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

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

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

#### 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。

#### 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。

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

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

最后一天的大涨，给2020年划上了一个完美的句号，2020年，对于机构投资者无疑是最为丰收的一年，在这一年里，基金中位数（偏股型基金中位数58%）大幅跑赢了沪深300、中证500等一系列宽基指数，并且是连续第二年获得了非常不错的收益率，这在A股这个牛短熊长的市场里是非常少见的。

在这一年里，所幸市场眷顾，本基金全年收益率72.45%，排名在市场前四分之一左右，并且在过去的4年中，本基金每年都保持了在市场同类基金排名三分之一到四分之一分位数的水平。虽然这个成绩算不上突出，但是至少在过去四年中，无论市场行情如何变化，本基金都保持了业绩和排名的相对稳定。2020年的市场让我们学到了非常多的经验，也正是这些经验使得我们能够不断的成长，不断的提高，使我们对市场，对自身也有了更为深刻的理解。

(1) 研究需要做预判，投资更为重要的是做应对。2020年全球疫情的爆发，极大的影响了市场的节奏，在全球疫情扩散之时，由于我们认为之前自己对于国内疫情影响的预判正确，认为这次全球疫情即便扩散，对市场的影响也不会太大，从而导致了一季度末的回撤，现在反思，其实很多时候，当风险来临的时候，我们更多需要的是做出相

应的应对，而非固守自己的判断，即便事后来看，这种判断是正确的。因为在这种时候，风险的控制，远比收益率更为重要；

(2) 选择好公司是机构投资者的生命线。2020年的市场是极具诱惑的市场，一季度各种风格的股票都在上涨，但最终来看，如果不是一个真正的好公司，即便是同样的行业，最终走势都会相差十万八千里，但是我们往往在投资中会因为估值，股价的高低，短期催化剂等因素而放松了对于公司质地的要求，最终一旦我们稍不小心，就会竹篮打水。因此，从长期来看，要想长期走下去，只有和最有竞争力，最优秀的公司作伴，才能持续获得阿尔法；

(3) 兵无常势，水无常形，投资的主要矛盾在不同的市场环境下，应该有所变化。2020年由于估值的因素，我们在部分公司上过早下车，事后反思，其实在震荡市，公司的估值有明显的天花板，但是在牛市，更为重要的是公司天花板、长期的成长性以及公司的质地。而相对的，公司的估值可能没有那么重要了，因为估值最终是由增量资金的风险偏好决定，我们无法判断增量资金的风险偏好，但确定的是，好的标的人人都盯着，直接导致了这种公司的易涨难跌，因此，在牛市中，公司的好坏远比估值重要的多得多。

最后，回顾过去几年的风风雨雨，感谢投资者对于我们的信任和支持。但在这几年里，我们也看到了无数投资者将基金作为股票，来波段操作，最终反而一不小心丢掉了大部分盈利。过去无数的统计数据表明，基金投资的收益率与持有的时间长度成正相关性，其实，我们在做投资时已经做了很多风险控制措施，基金作为一个投资组合，其波动性和风险都小于个股和市场，因此不妨给予我们一些耐心，给予这些优秀的上市公司一些耐心，让我们共同见证这些优秀公司的不断成长，我相信，我们最终也将会获得丰厚的回报！

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通可持续混合基金份额净值为2.193元，本报告期内，基金份额净值增长率为15.02%，同期业绩比较基准收益率为10.88%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	946,589,129.32	87.76
	其中：股票	946,589,129.32	87.76

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	606,648.60	0.06
	其中：债券	606,648.60	0.06
	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	89,128,253.10	8.26
8	其他资产	42,328,578.92	3.92
9	合计	1,078,652,609.94	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	738,673,235.28	71.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	21,439,334.80	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,942,158.33	5.90
J	金融业	37,045,455.00	3.59
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	57,208,385.44	5.54
N	水利、环境和公共设施管理业	42,345.11	0.00



O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	31,212,917.50	3.02
S	综合	-	-
	合计	946,589,129.32	91.65

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300601	康泰生物	337,743	58,936,153.50	5.71
2	603259	药明康德	424,547	57,194,971.84	5.54
3	600519	贵州茅台	27,792	55,528,416.00	5.38
4	603456	九洲药业	1,536,288	54,999,110.40	5.33
5	002050	三花智控	2,149,145	52,976,424.25	5.13
6	300750	宁德时代	140,933	49,482,985.63	4.79
7	002507	涪陵榨菜	1,129,934	47,796,208.20	4.63
8	600690	海尔智家	1,406,382	41,080,418.22	3.98
9	002475	立讯精密	722,051	40,521,502.12	3.92
10	600276	恒瑞医药	363,132	40,474,692.72	3.92

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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）	606,648.60	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	606,648.60	0.06

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	4,770	606,648.60	0.06

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中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。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1 报告期内**，本基金投资的前十名证券的九洲药业（证券代码：603456.SH）首次公开发行的原始股东蔡越因内幕交易，收到证监会行政处罚。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。

**5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	318,932.24
2	应收证券清算款	41,748,496.12
3	应收股利	-
4	应收利息	17,994.70
5	应收申购款	243,155.86
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	42,328,578.92

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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。

#### 5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	108,031,545.66
报告期期间基金总申购份额	680,139,953.77
减：报告期期间基金总赎回份额	317,109,387.25
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	471,062,112.18

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。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	13,196,307.09
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,196,307.09
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.80

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2020年3月02日	4,282,119.91	8,000,000.00	1000元/笔
2	申购	2020年7月20日	8,914,187.18	20,334,260.96	1000元/笔
合计			13,196,307.09	28,334,260.96	

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020-12-21 至 2020-12-31	0.00	119,047,222.22	0.00	119,047,222.22	25.27%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金在投资管理中会至少维持60%的股票投资比例，不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场涨幅。在股票资产配置上，本基金主要投资于可持续发展特征突出的公司股票，而市场整体并不全部符合本基金的选股标准。在特定的投资期间之内，本基金的收益率可能会与市场整体产生偏差。基金经理主观判断错误的风险。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。本基金可投资于存托凭证，需关注存托凭证存续期间的风险。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。

### 8.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《上海证券报》及管理人网站进行了如下信息披露：

1、2020年10月27日披露了《财通可持续发展主题混合型证券投资基金2020年第三季度报告》；

2、2020年11月6日披露了《财通基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法人员假冒财通基金名义实施非法证券行为的公告》；

3、2020年11月19日披露了《财通可持续发展主题混合型证券投资基金暂停大额申购（转换转入）业务的公告》；

4、2020年12月15日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加信达证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

5、2020年12月16日披露了《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》；

6、2020年12月17日披露了《财通基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》；

7、2020年12月17日披露了《财通可持续发展主题混合型证券投资基金基金产品资料概要更新》；

8、2020年12月17日披露了《财通可持续发展主题混合型证券投资基金更新招募说明书》；

9、2020年12月17日披露了《财通可持续发展主题混合型证券投资基金基金合同》；

10、2020年12月17日披露了《财通可持续发展主题混合型证券投资基金托管协议》；

11、2020年12月21日披露了《财通可持续发展主题混合型证券投资基金分红公告》；

12、2020年12月31日披露了《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“2021倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告》；

13、2020年12月31日披露了《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》；

14、2020年第一季度，本基金管理人使用风险准备金八百万元投资于本基金；

15、本报告期内，公司按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定每日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、财通可持续发展主题混合型证券投资基金基金合同；
- 3、财通可持续发展主题混合型证券投资基金基金托管协议；
- 4、财通可持续发展主题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。

### 9.2 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。

### 9.3 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  
二〇二一年一月二十一日