

财通价值动量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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	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	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 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	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12	投资组合报告附注.....	53
§8	基金份额持有人信息.....	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9	开放式基金份额变动.....	55
§10	重大事件揭示.....	55
10.1	基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4	基金投资策略的改变.....	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8	其他重大事件.....	62
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§12	备查文件目录.....	64
12.1	备查文件目录.....	64
12.2	存放地点.....	65
12.3	查阅方式.....	65

## §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	484,541,186.32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	武祎	郭明
	联系电话	021-20537888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-9888	95588
传真		021-20537999	(010) 66105798
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		夏理芬	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
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	367,702,302.17
本期利润	183,838,602.07
加权平均基金份额本期利润	0.3437
本期加权平均净值利润率	8.58%
本期基金份额净值增长率	7.98%
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	1,106,185,690.52
期末可供分配基金份额利润	2.2830
期末基金资产净值	1,934,024,359.42
期末基金份额净值	3.991
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	427.90%

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

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(3)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.29%	1.50%	-1.15%	0.49%	-0.14%	1.01%
过去三个月	5.61%	1.55%	2.49%	0.59%	3.12%	0.96%
过去六个月	7.98%	2.08%	1.06%	0.79%	6.92%	1.29%
过去一年	19.10%	1.90%	16.29%	0.80%	2.81%	1.10%

过去三年	161.53%	2.02%	35.49%	0.82%	126.04%	1.20%
自基金合同生效起至今	427.90%	1.67%	89.42%	0.87%	338.48%	0.80%

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



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，截至本报告期末，因市场波动，本基金股票仓位超过80%。除此之外，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		
金梓才	本基金的 基金经 理、基金 投资部总 监	2014-11-1 9	-	11年	上海交通大学工学硕士。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，现任基金投资部总监、基金经理。

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

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

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年开始，市场风格达到极致，各行业龙头有了一波快速上涨，堪称2020年下半年市场风格的延续。但在春节以后，市场风格出现了剧烈变化，各个行业的茅属性公司出现剧烈下跌，跌幅超过行业内其他公司。从板块来看，周期行业在一季度涨幅居前，消费和成长各个行业相对排名靠后，但半导体和新能源行业在五月开始上涨明显。

在我们看来，2021年投资的关键词就是“涨价”。不论是在新能源行业上游，还是和传统经济更相关的各种资源品，都在2021年上半年跑出了较好的收益。我们认为这样的情况会延续到下半年，主要原因为：1）海外经济复苏态势强劲且持续性强，拉动了我国制造业行业的景气度，外需逻辑延续全年；2）在全球碳中和背景下，越是上游资源品，越是“两高”行业，未来的供给曲线都是相对平缓的，供给在一段时间内无法匹配需求的增长；3）全球流动性宽裕，我们本来预期今年的流动性收紧迟迟没有出现，也拉高了资源品上涨的幅度。

从上半年我们的配置来看，相比2020年末，我们在2021年初开始持仓上更偏重周期各个方向，并且在持仓结构上更偏重二三线公司，我们在1月份已完成上述调整。在需求逻辑上，我们相对在下半年看好化工和新能源上游资源品的价格表现，因为这两个行业的需求逻辑在下半年更强，其他需求逻辑不强的周期品更有赖于供给逻辑的不断深化。令我们担忧的是，在未来，我们看到的是确定性的周期各个行业的供给扩张逻辑受限，并且这种受限并不是短期的，而是长期的。同时全球流动性仍然宽裕，迟迟未能出现流动性逐步收缩的状态。这样就可能造成资源品价格长期的高位运行，故我们对通胀的担忧是较多的，我们目前没有看到通胀缓和的迹象。

##### 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3.991元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.98%，同期业绩比较基准收益率为1.06%。

#### 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2021年下半年，我们仍然认为涨价逻辑还能延续一段时间。全球流动性仍然相对宽裕并且全球经济复苏周期进入到下半场，我们认为随着下半年经济旺季的到来，部分产业链的涨价投资机会仍将延续。与此同时，我们也开始密切跟踪各个行业基本面的可能变化，在部分领域产能供给在慢慢释放，可能导致之前的产品涨价告一段落，同时我们也在关注之前受到上游涨价压制的产业链环节，有无可能产生基本面的反转。总体上，我们已经开始积极的关注其他的可能性的投资机会，以期适时的调整组合。

在行业配置层面，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，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》。

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），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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%；

本报告期内本基金未进行过利润分配。

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

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，财通价值动量混合型证券投资基金的管理人—财通基金管理有限公司在财通价值动量混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对财通基金管理有限公司编制和披露的财通价值动量混合型证券投资基金2021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 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：财通价值动量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	178,980,456.06	272,450,742.10

结算备付金		4,065,438.03	6,377,716.73
存出保证金		746,294.05	814,229.16
交易性金融资产	6.4.7.2	1,780,230,830.32	2,008,694,068.42
其中：股票投资		1,552,836,044.08	1,863,521,129.87
基金投资		-	-
债券投资		227,394,786.24	145,172,938.55
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		372,661.48	78,775,153.86
应收利息	6.4.7.5	297,141.17	126,915.94
应收股利		-	-
应收申购款		5,686,737.43	6,121,257.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,970,379,558.54	2,373,360,083.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		15,693,737.73	19,957,444.68
应付赎回款		14,606,763.32	23,015,477.57
应付管理人报酬		2,628,177.30	2,922,224.02
应付托管费		438,029.52	487,037.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,049,550.39	2,726,834.06

应交税费		3,149.10	2,307.91
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	935,791.76	1,077,391.04
负债合计		36,355,199.12	50,188,716.64
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	484,541,186.32	628,578,735.29
未分配利润	6.4.7.10	1,449,483,173.10	1,694,592,631.82
所有者权益合计		1,934,024,359.42	2,323,171,367.11
负债和所有者权益总计		1,970,379,558.54	2,373,360,083.75

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3.991元，基金份额总额484,541,186.32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：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		210,718,836.60	877,737,830.60
1.利息收入		967,939.02	1,470,383.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	319,903.07	1,236,098.75
债券利息收入		648,035.95	217,494.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	16,790.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填		392,011,236.66	435,446,164.49

列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.12	365,329,582.30	386,429,749.78
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	11,295,737.62	41,993,809.35
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	15,385,916.74	7,022,605.36
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.18	-183,863,700.10	434,226,644.37
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	1,603,361.02	6,594,638.47
<b>减：二、费用</b>		26,880,234.53	35,691,522.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	15,931,475.08	20,224,957.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,655,245.80	3,370,826.26
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	8,164,084.73	11,967,557.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		2,332.98	782.86
7. 其他费用	6.4.7.21	127,095.94	127,398.38
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		183,838,602.07	842,046,307.79
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		183,838,602.07	842,046,307.79

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：财通价值动量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)	628,578,735.29	1,694,592,631.82	2,323,171,367.11
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	183,838,602.07	183,838,602.07
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)	-144,037,548.97	-428,948,060.79	-572,985,609.76
其中：1.基金申购款	228,376,479.21	700,864,458.33	929,240,937.54
2.基金赎回 款	-372,414,028.18	-1,129,812,519.12	-1,502,226,547.30
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)	484,541,186.32	1,449,483,173.10	1,934,024,359.42
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)	1,238,278,396.74	1,786,379,935.66	3,024,658,332.40
二、本期经营活动产生 的基金净值变动	-	842,046,307.79	842,046,307.79

数(本期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-374,665,638.61	-597,847,565.69	-972,513,204.30
其中：1.基金申购款	1,189,168,644.23	2,363,950,377.41	3,553,119,021.64
2.基金赎回款	-1,563,834,282.84	-2,961,797,943.10	-4,525,632,225.94
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)	863,612,758.13	2,030,578,677.76	2,894,191,435.89

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。

本基金是混合型证券投资基金，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上半年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 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	178,980,456.06
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	178,980,456.06

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	1,553,354,824.62	1,552,836,044.08	-518,780.54	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	234,084,449.30	227,394,786.24	-6,689,663.06
	银行间市场	-	-	-
	合计	234,084,449.30	227,394,786.24	-6,689,663.06

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,787,439,273.92	1,780,230,830.32	-7,208,443.60

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度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

本基金本年度末及上年度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

本基金本报告期末及上年度末均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	13,496.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,646.55
应收债券利息	281,695.75
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	302.31
合计	297,141.17

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	2,049,550.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,049,550.39

#### 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	500,000.00
应付赎回费	46,695.82
预提费用	389,095.94
合计	935,791.76

#### 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	628,578,735.29	628,578,735.29
本期申购	228,376,479.21	228,376,479.21
本期赎回（以“-”号填列）	-372,414,028.18	-372,414,028.18
本期末	484,541,186.32	484,541,186.32

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	1,003,917,797.73	690,674,834.09	1,694,592,631.82

本期利润	367,702,302.17	-183,863,700.10	183,838,602.07
本期基金份额交易产生的变动数	-265,434,409.38	-163,513,651.41	-428,948,060.79
其中：基金申购款	479,111,267.91	221,753,190.42	700,864,458.33
基金赎回款	-744,545,677.29	-385,266,841.83	-1,129,812,519.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,106,185,690.52	343,297,482.58	1,449,483,173.10

#### 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	262,001.96
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	36,996.59
其他	20,904.52
合计	319,903.07

注：本基金本期末其他利息收入包括结算保证金利息收入和应收申购款利息收入，分别为7058.85元和13845.67元。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	3,167,864,955.64
减：卖出股票成本总额	2,802,535,373.34
买卖股票差价收入	365,329,582.30

#### 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



单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	11,295,737.62
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	11,295,737.62

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	409,625,351.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	397,972,644.40
减：应收利息总额	356,969.48
买卖债券差价收入	11,295,737.62

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未投资资产支持证券，资产支持证券收益为零。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--申购差价收入。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

#### 6.4.7.17 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	15,385,916.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,385,916.74

#### 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	-183,863,700.10
——股票投资	-173,383,963.11
——债券投资	-10,479,736.99
——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	-183,863,700.10

#### 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	1,601,888.60
转换费收入	1,472.42
合计	1,603,361.02

#### 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	8,164,084.73
银行间市场交易费用	-
合计	8,164,084.73

#### 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
帐户维护费	18,000.00

合计	127,095.94
----	------------

#### 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

##### 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：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	229,062,734.26	3.93%	56,493,693.88	0.67%

##### 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	208,744.75	4.71%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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	51,482.34	0.80%	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。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 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	15,931,475.08	20,224,957.46
其中：支付销售机构的客户维护费	3,633,580.84	7,636,417.36

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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年06月30日	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	2,655,245.80	3,370,826.26

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

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年06月30日		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

中国工商银行股份有限公司	178,980,456.06	262,001.96	245,207,570.64	1,143,916.76
--------------	----------------	------------	----------------	--------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无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
300623	捷捷微电	2020-01-10	2022-01-10	非公开发售	21.18	34.42	82,625	1,749,997.50	2,843,952.50	-
300623	捷捷微电	2020-05-26	2022-01-10	非公开发售-送股	-	34.42	49,575	-	1,706,371.50	-
300	捷捷	2021-	2022-	非公开发	-	34.4	66,10	-	2,275,	-

623	微电	04-29	01-10	行限售-送 股		2	0		162.00	
688 183	生益 电子	2021- 02-10	2021- 08-25	新股限售	12. 42	14.1 9	18,39 4	228,45 3.48	261,01 0.86	-
300 957	贝泰 妮	2021- 03-18	2021- 09-27	新股限售	47. 33	251. 96	853	40,37 2.49	214,92 1.88	-
688 345	博力 威	2021- 06-03	2021- 12-13	新股限售	25. 91	55.5 3	2,332	60,42 2.12	129,49 5.96	-
688 661	和林 微纳	2021- 03-19	2021- 09-29	新股限售	17. 71	84.0 1	1,452	25,71 4.92	121,98 2.52	-
688 625	呈和 科技	2021- 05-31	2021- 12-07	新股限售	16. 48	42.6 3	2,672	44,03 4.56	113,90 7.36	-
688 682	霍莱 沃	2021- 04-13	2021- 10-20	新股限售	45. 72	103. 85	946	43,25 1.12	98,24 2.10	-
688 499	利元 亨	2021- 06-23	2021- 07-01	认购新发 证券	38. 85	38.8 5	2,149	83,48 8.65	83,48 8.65	-
688 633	星球 石墨	2021- 03-17	2021- 09-24	新股限售	33. 62	53.1 4	1,558	52,37 9.96	82,79 2.12	-
300 979	华利 集团	2021- 04-15	2021- 10-26	新股限售	33. 22	87.5 0	925	30,72 8.50	80,93 7.50	-
301 018	申菱 环境	2021- 06-28	2021- 07-07	认购新发 证券	8.2 9	8.29	7,029	58,27 0.41	58,27 0.41	-
301 018	申菱 环境	2021- 06-28	2022- 01-07	新股限售	8.2 9	8.29	782	6,482. 78	6,482. 78	-
300 981	中红 医疗	2021- 04-19	2021- 10-27	新股限售	48. 59	90.3 9	601	29,20 2.59	54,32 4.39	-
688 087	英科 再生	2021- 06-30	2021- 07-09	认购新发 证券	21. 96	21.9 6	2,469	54,21 9.24	54,21 9.24	-
301 017	漱玉 平民	2021- 06-23	2021- 07-05	认购新发 证券	8.8 6	8.86	4,995	44,25 5.70	44,25 5.70	-
301 017	漱玉 平民	2021- 06-23	2022- 01-05	新股限售	8.8 6	8.86	555	4,917. 30	4,917. 30	-
301	密封	2021-	2021-	认购新发	10.	10.6	3,789	40,31	40,31	-



020	科技	06-28	07-06	证券	64	4		4.96	4.96	
301 020	密封 科技	2021- 06-28	2022- 01-06	新股限售	10. 64	10.6 4	421	4,479. 44	4,479. 44	-
301 021	英诺 激光	2021- 06-28	2021- 07-06	认购新发 证券	9.4 6	9.46	2,609	24,68 1.14	24,68 1.14	-
301 021	英诺 激光	2021- 06-28	2022- 01-06	新股限售	9.4 6	9.46	290	2,743. 40	2,743. 40	-
300 953	震裕 科技	2021- 03-11	2021- 09-22	新股限售	28. 77	99.8 5	240	6,904. 80	23,96 4.00	-
301 009	可靠 股份	2021- 06-08	2021- 12-17	新股限售	12. 54	27.8 9	801	10,04 4.54	22,33 9.89	-
300 941	创识 科技	2021- 02-02	2021- 08-09	新股限售	21. 31	49.9 4	399	8,502. 69	19,92 6.06	-
301 015	百洋 医药	2021- 06-22	2021- 12-30	新股限售	7.6 4	38.8 3	462	3,529. 68	17,93 9.46	-
688 226	威腾 电气	2021- 06-28	2022- 01-07	认购新发 证券	6.4 2	6.42	2,693	17,28 9.06	17,28 9.06	-
300 982	苏文 电能	2021- 04-19	2021- 10-27	新股限售	15. 83	45.2 9	317	5,018. 11	14,35 6.93	-
300 968	格林 精密	2021- 04-06	2021- 10-15	新股限售	6.8 7	12.0 7	1,162	7,982. 94	14,02 5.34	-
300 940	南极 光	2021- 01-27	2021- 08-03	新股限售	12. 76	43.3 8	307	3,917. 32	13,31 7.66	-
300 614	百川 畅银	2021- 05-18	2021- 11-25	新股限售	9.1 9	40.3 8	329	3,023. 51	13,28 5.02	-
300 937	药易 购	2021- 01-20	2021- 07-27	新股限售	12. 25	53.7 1	244	2,989. 00	13,10 5.24	-
301 013	利和 兴	2021- 06-21	2021- 12-29	新股限售	8.7 2	27.1 1	471	4,107. 12	12,76 8.81	-
300 942	易瑞 生物	2021- 02-02	2021- 08-09	新股限售	5.3 1	28.5 2	443	2,352. 33	12,63 4.36	-
300 933	中辰 股份	2021- 01-15	2021- 07-22	新股限售	3.3 7	10.4 4	1,112	3,747. 44	11,60 9.28	-

301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	8.67	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021-06-04	2021-08-25	新股限售-送股	-	27.42	108	-	2,961.36	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股限售	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
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	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300	博俊	2020-	2021-	新股限售	10.	22.2	359	3,862.	7,969.	-

926	科技	12-29	07-07		76	0		84	80	
300 993	玉马 遮阳	2021- 05-17	2021- 11-24	新股限售	12. 10	19.2 9	410	4,961. 00	7,908. 90	-
300 930	屹通 新材	2021- 01-13	2021- 07-21	新股限售	13. 11	24.4 8	322	4,221. 42	7,882. 56	-
300 985	致远 新能	2021- 04-21	2021- 10-29	新股限售	24. 90	24.8 1	295	7,345. 50	7,318. 95	-
300 971	博亚 精工	2021- 04-07	2021- 10-15	新股限售	18. 24	28.2 9	245	4,468. 80	6,931. 05	-
301 004	嘉益 股份	2021- 06-18	2021- 12-27	新股限售	7.8 1	21.9 4	312	2,436. 72	6,845. 28	-
300 991	创益 通	2021- 05-12	2021- 11-22	新股限售	13. 06	26.5 1	254	3,317. 24	6,733. 54	-
300 927	江天 化学	2020- 12-29	2021- 07-07	新股限售	13. 39	30.1 0	217	2,905. 63	6,531. 70	-
300 975	商络 电子	2021- 04-14	2021- 10-21	新股限售	5.4 8	13.0 3	492	2,696. 16	6,410. 76	-
300 963	中洲 特材	2021- 03-30	2021- 10-11	新股限售	12. 13	22.4 9	283	3,432. 79	6,364. 67	-
301 011	华立 科技	2021- 06-09	2021- 12-17	新股限售	14. 20	33.8 4	175	2,485. 00	5,922. 00	-
300 943	春晖 智控	2021- 02-03	2021- 08-10	新股限售	9.7 9	23.0 1	255	2,496. 45	5,867. 55	-
300 967	晓鸣 股份	2021- 04-02	2021- 10-13	新股限售	4.5 4	11.5 4	507	2,301. 78	5,850. 78	-
300 972	万辰 生物	2021- 04-08	2021- 10-19	新股限售	7.1 9	12.6 5	430	3,091. 70	5,439. 50	-
300 929	华骐 环保	2021- 01-12	2021- 07-20	新股限售	13. 87	29.5 5	183	2,538. 21	5,407. 65	-
300 960	通业 科技	2021- 03-22	2021- 09-29	新股限售	12. 08	23.0 6	234	2,826. 72	5,396. 04	-
300 995	奇德 新材	2021- 05-17	2021- 11-26	新股限售	14. 72	23.3 2	191	2,811. 52	4,454. 12	-

301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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	178,980,456.06	-	-	-	-	-	178,980,456.06
结算备付金	4,065,438.03	-	-	-	-	-	4,065,438.03
存出保证	746,294.05	-	-	-	-	-	746,294.05

金							
交易性金融资产	-	-	-	103,503,798.00	123,890,988.24	1,552,836,044.08	1,780,230,830.32
应收证券清算款	-	-	-	-	-	372,661.48	372,661.48
应收利息	-	-	-	-	-	297,141.17	297,141.17
应收申购款	994.04	-	-	-	-	5,685,743.39	5,686,737.43
资产总计	183,793,182.18	-	-	103,503,798.00	123,890,988.24	1,559,191,590.12	1,970,379,558.54
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	15,693,737.73	15,693,737.73
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,606,763.32	14,606,763.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,628,177.30	2,628,177.30
应付托管费	-	-	-	-	-	438,029.52	438,029.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,049,550.39	2,049,550.39
应交税费	-	-	-	-	-	3,149.10	3,149.10
其他负债	-	-	-	-	-	935,791.76	935,791.76
负债总计	-	-	-	-	-	36,355,199.12	36,355,199.12

利率 敏感 度缺 口	183,793,18 2.18	-	-	103,503,79 8.00	123,890,98 8.24	1,522,836,39 1.00	1,934,024,35 9.42
上年 度末 2020 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	272,450,74 2.10	-	-	-	-	-	272,450,742. 10
结算 备付 金	6,377,716.7 3	-	-	-	-	-	6,377,716.73
存出 保证 金	814,229.16	-	-	-	-	-	814,229.16
交易 性金 融资 产	-	-	-	145,172,93 8.55	-	1,863,521,12 9.87	2,008,694,06 8.42
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	78,775,153.8 6	78,775,153.8 6
应收 利息	-	-	-	-	-	126,915.94	126,915.94
应收 申购 款	-	-	-	-	-	6,121,257.54	6,121,257.54
资产 总计	279,642,68 7.99	-	-	145,172,93 8.55	-	1,948,544,45 7.21	2,373,360,08 3.75
负债							
应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	19,957,444.6 8	19,957,444.6 8



应付赎回款	-	-	-	-	-	23,015,477.57	23,015,477.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,922,224.02	2,922,224.02
应付托管费	-	-	-	-	-	487,037.36	487,037.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,726,834.06	2,726,834.06
应交税费	-	-	-	-	-	2,307.91	2,307.91
其他负债	-	-	-	-	-	1,077,391.04	1,077,391.04
负债总计	-	-	-	-	-	50,188,716.64	50,188,716.64
利率敏感度缺口	279,642,687.99	-	-	145,172,938.55	-	1,898,355,740.57	2,323,171,367.11

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均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，股票投资（含存托凭证）比例为基金资产的30%-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%，现金及到期日在一年以内的政府国债的比例不低于基金资产净值的5%。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	1,552,836,044.08	80.29	1,863,521,129.87	80.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	227,394,786.24	11.76	145,172,938.55	6.25
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	1,780,230,830.32	92.05	2,008,694,068.42	86.46

#### 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%	30,781,711.13	44,501,294.91
	业绩比较基准减少1%	-30,781,711.13	-44,501,294.91

#### 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1,771,452,788.15元，属于第二层次的余额为人民币305,230.10元，属于第三层次的余额为人民币8,472,812.07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1,732,449,024.96元，属于第二层次的余额为人民币207,119.06元，属于第三层次的余额为人民币276,037,924.40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 276,037,924.40

转入第三层次 -

转出第三层次 258,446,171.28

当期计入损益的利得或损失总额 -9,878,485.12

购买 759,544.07

出售 -

本期末 8,472,812.07

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 5,956,502.03

## 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	1,552,836,044.08	78.81
	其中：股票	1,552,836,044.08	78.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	227,394,786.24	11.54
	其中：债券	227,394,786.24	11.54
	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	183,045,894.09	9.29
8	其他各项资产	7,102,834.13	0.36
9	合计	1,970,379,558.54	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	214,388,770.49	11.09
C	制造业	1,338,071,428.72	69.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,014.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	156,349.99	0.01
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,552,836,044.08	80.29

### 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	600328	中盐化工	10,081,182	140,834,112.54	7.28
2	002064	华峰化学	9,866,099	140,098,605.80	7.24
3	000683	远兴能源	27,943,259	130,495,019.53	6.75
4	002092	中泰化学	12,384,063	127,184,327.01	6.58
5	600409	三友化工	11,529,501	116,563,255.11	6.03
6	000933	神火股份	10,826,676	102,312,088.20	5.29
7	000703	恒逸石化	8,229,920	98,347,544.00	5.09
8	300502	新易盛	2,775,046	86,720,187.50	4.48
9	000422	湖北宜化	9,299,879	81,466,940.04	4.21
10	601918	新集能源	16,557,631	80,966,815.59	4.19
11	600219	南山铝业	21,477,337	77,318,413.20	4.00
12	002532	天山铝业	7,292,900	61,187,431.00	3.16
13	002541	鸿路钢构	999,950	58,347,082.50	3.02
14	601600	中国铝业	10,655,246	56,472,803.80	2.92
15	300570	太辰光	3,244,697	51,915,152.00	2.68
16	601001	晋控煤业	6,609,108	47,982,124.08	2.48
17	600985	淮北矿业	3,534,129	43,151,715.09	2.23
18	601699	潞安环能	3,579,814	42,277,603.34	2.19
19	300623	捷捷微电	198,300	6,825,486.00	0.35
20	688183	生益电子	18,394	261,010.86	0.01
21	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
22	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.01
23	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
24	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.01
25	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01

26	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.01
27	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.00
28	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
29	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.00
30	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
31	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
32	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
33	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
34	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
35	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
36	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.00
37	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
38	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
39	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
40	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
41	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
42	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
43	301015	N百洋	462	17,939.46	0.00
44	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
45	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
46	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
47	605180	华生科技	384	14,208.00	0.00
48	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
49	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
50	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
51	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
52	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
53	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
54	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.00
55	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
56	603171	N税友	637	12,230.40	0.00

57	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
58	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
59	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
60	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
61	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
62	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
63	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
64	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
65	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
66	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
67	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
68	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
69	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
70	301016	N雷尔伟	275	9,069.50	0.00
71	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
72	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
73	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
74	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
75	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
76	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
77	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
78	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
79	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
80	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
81	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
82	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
83	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
84	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
85	301004	C嘉益	312	6,845.28	0.00
86	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
87	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00



88	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
89	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
90	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
91	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
92	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
93	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
94	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
95	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
96	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
97	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
98	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
99	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
100	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	000703	恒逸石化	137,615,870.67	5.92
2	000933	神火股份	135,533,928.02	5.83
3	002064	华峰化学	130,634,658.12	5.62
4	000683	远兴能源	129,318,545.05	5.57
5	600328	中盐化工	113,611,804.35	4.89
6	600019	宝钢股份	110,016,846.30	4.74
7	600219	南山铝业	106,316,514.51	4.58
8	000932	华菱钢铁	98,616,948.46	4.24
9	600782	新钢股份	98,009,202.47	4.22
10	600426	华鲁恒升	96,797,646.12	4.17
11	600988	赤峰黄金	90,040,653.37	3.88
12	601600	中国铝业	87,420,721.54	3.76

13	600282	南钢股份	86,885,228.48	3.74
14	002318	久立特材	86,329,999.02	3.72
15	002092	中泰化学	86,013,713.22	3.70
16	000959	首钢股份	84,451,975.88	3.64
17	002532	天山铝业	81,853,014.70	3.52
18	601918	新集能源	80,172,995.80	3.45
19	000422	湖北宜化	79,031,770.23	3.40
20	601168	西部矿业	77,412,199.50	3.33
21	300568	星源材质	73,300,348.93	3.16
22	600409	三友化工	72,099,587.52	3.10
23	002541	鸿路钢构	60,387,437.24	2.60
24	600188	兖州煤业	55,766,561.88	2.40
25	000301	东方盛虹	55,012,160.96	2.37
26	601001	晋控煤业	54,570,928.72	2.35
27	600985	淮北矿业	46,843,071.12	2.02
28	601699	潞安环能	46,711,661.05	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（成交价乘以成交数量）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	000301	东方盛虹	188,992,915.42	8.14
2	600426	华鲁恒升	161,820,275.58	6.97
3	002493	荣盛石化	149,833,214.24	6.45
4	603456	九洲药业	148,102,414.25	6.38
5	600309	万华化学	142,008,256.41	6.11
6	600346	恒力石化	131,170,547.11	5.65
7	300394	天孚通信	118,441,656.44	5.10
8	300363	博腾股份	114,336,460.68	4.92
9	300408	三环集团	107,683,513.93	4.64

10	601888	中国中免	103,945,600.52	4.47
11	600019	宝钢股份	102,595,523.19	4.42
12	000932	华菱钢铁	98,091,834.87	4.22
13	600782	新钢股份	91,581,172.00	3.94
14	603993	洛阳钼业	88,300,764.50	3.80
15	603520	司太立	85,439,936.74	3.68
16	601899	紫金矿业	84,977,778.00	3.66
17	600486	扬农化工	84,314,926.15	3.63
18	600988	赤峰黄金	82,497,644.34	3.55
19	002318	久立特材	76,837,903.87	3.31
20	002600	领益智造	75,899,510.33	3.27
21	000959	首钢股份	75,466,342.17	3.25
22	603113	金能科技	75,344,005.56	3.24
23	600460	士兰微	75,106,420.98	3.23
24	600282	南钢股份	73,128,526.81	3.15
25	601168	西部矿业	71,013,633.04	3.06
26	000683	远兴能源	69,933,292.40	3.01
27	600188	兖州煤业	69,036,676.50	2.97
28	300568	星源材质	57,872,088.96	2.49
29	300118	东方日升	47,261,228.82	2.03

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	2,665,234,250.66
卖出股票收入（成交）总额	3,167,864,955.64

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)	227,394,786.24	11.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	227,394,786.24	11.76

#### 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	113508	新风转债	789,800	102,523,938.00	5.30
2	127023	华菱转2	656,694	87,051,356.64	4.50
3	127022	恒逸转债	299,997	36,839,631.60	1.90
4	128017	金禾转债	6,000	979,860.00	0.05

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂不投资股指期货。

### 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 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 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形。

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	746,294.05
2	应收证券清算款	372,661.48
3	应收股利	-
4	应收利息	297,141.17
5	应收申购款	5,686,737.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,102,834.13

### 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	113508	新风转债	102,523,938.00	5.30
2	127023	华菱转2	87,051,356.64	4.50
3	127022	恒逸转债	36,839,631.60	1.90
4	128017	金禾转债	979,860.00	0.05

### 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
93,132	5,202.74	225,967,781.11	46.640%	258,573,405.21	53.360%

### 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	211,082.15	0.040%

### 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、基金投资和研部	0~10

门负责人持有本开放式基金	
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	628,578,735.29
本报告期基金总申购份额	228,376,479.21
减：本报告期基金总赎回份额	372,414,028.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	484,541,186.32

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、中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	286,116.96	0.00%	203.52	0.00%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	229,062,734.26	3.93%	208,744.75	4.71%	-
长江证券	2	853,330,415.98	14.65%	615,072.82	13.87%	-
东北证券	2	607,481,563.67	10.43%	434,845.48	9.81%	-
东方财富证券股份	2	-	-	-	-	-



有限公司						
东方 证券	2	473,190,797.61	8.12%	341,952.79	7.71%	-
东海 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	386,216,316.14	6.63%	275,763.14	6.22%	-
高华 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	344,642,561.26	5.92%	252,036.91	5.68%	-
广发 证券	2	365,539,897.90	6.28%	333,117.52	7.51%	-
国金 证券	2	63,576,242.61	1.09%	57,937.53	1.31%	-
国联 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 君安	2	272,841,126.47	4.68%	198,163.92	4.47%	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
国元 证券	2	42,091,155.53	0.72%	38,358.81	0.86%	-
海通 证券	2	-	-	-	-	-
华创 证券	2	518,730,970.99	8.91%	373,619.95	8.42%	-
华融 证券	2	-	-	-	-	-
华泰	2	-	-	-	-	-

证券						
江海 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
联讯 证券	2	-	-	-	-	-
民族 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
山西 证券	2	-	-	-	-	-
申银 万国	2	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	13,880,248.05	0.24%	12,649.13	0.29%	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
西南 证券	2	-	-	-	-	-
湘财 证券	2	105,478,878.48	1.81%	98,234.11	2.22%	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	732,856,182.54	12.58%	530,929.97	11.97%	-
银河 证券	2	19,102,726.47	0.33%	13,969.98	0.32%	-
招商	2	308,178,395.82	5.29%	287,004.82	6.47%	-

证券						
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	220,377,040.93	3.78%	161,161.40	3.63%	-
中信建投证券	2	99,869,495.63	1.71%	73,032.76	1.65%	-
中信证券	2	23,998,174.00	0.41%	22,349.64	0.50%	-
东兴证券	3	144,344,659.51	2.48%	105,558.19	2.38%	-
安信证券	4	-	-	-	-	-

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	15,978,904.07	1.77%	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	200,825,881.53	22.29%	-	-	-	-	-	-
东北证券	133,452,739.59	14.81%	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	26,949,251.20	2.99%	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	69,543,297.70	7.72%	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	19,327,356.90	2.15%	-	-	-	-	-	-
广发证券	165,061,734.43	18.32%	-	-	-	-	-	-
国金证券	11,235,718.25	1.25%	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	149,065,089.20	16.5 5%	-	-	-	-	-	-

银河证券	34,051,690.40	3.78%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	75,460,733.30	8.38%	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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基金参与交通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	2021-01-04
2	《财通价值动量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	中国证监会指定报刊	2021-01-22

	下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》	及网站	
4	《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
5	《关于财通价值动量混合型证券投资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	2021-03-13
6	《关于财通价值动量混合型证券投资基金增加山西证券股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-25
7	《财通价值动量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
8	《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
9	《财通价值动量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
10	《关于财通价值动量混合型证券投资基金增加中原证券股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
11	《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
12	《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
13	《财通基金管理有限公司关于旗	中国证监会指定报刊	2021-06-11

	下部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司基金费率优惠活动的公告》	及网站	
14	《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	2021-06-18
15	《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
16	《财通价值动量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
17	《财通价值动量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
18	《财通价值动量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

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、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