

财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
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	56
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	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2	期末上市基金前十名持有人	59
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§9	开放式基金份额变动	60
§10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8	其他重大事件	67
§11	影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	69
§12	备查文件目录	69
12.1	备查文件目录	69
12.2	存放地点	69
12.3	查阅方式	70

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	财通多策略升级混合(LOF)	
场内简称	财通升级混合LOF	
基金主代码	501015	
交易代码	501015	
基金运作方式	契约型、上市开放式(LOF)	
基金合同生效日	2016年03月09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	139,677,940.85份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016年06月06日	
下属分级基金的基金简称	财通多策略升级混合(LOF)A	财通多策略升级混合(LOF)C
下属分级基金场内简称	财通升级混合LOF	-
下属分级基金的交易代码	501015	015271
报告期末下属分级基金的份额总额	139,513,331.24份	164,609.61份

注：(1)本基金自2017年09月09日转型为上市开放式基金(LOF)；

(2)本基金自2022年3月3日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置

	<p>及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。</p> <p>本基金在价值投资理念的基础上，建立成长策略、主题策略、定向增发策略以及动量策略等多策略体系，并根据市场环境的变化进行针对性运用；固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法；权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标，选择权证的买入和卖出时机；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。</p>	
业绩比较基准	<p>沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%</p>	
风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。</p>	
下属分级基金的风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。</p>	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。</p>

### 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	姓名	方斌	郭明

露负责人	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	《证券时报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期	
	(2023年01月01日-2023年06月30日)	
	财通多策略升级混合(LOF)A	财通多策略升级混合(LOF)C

本期已实现收益	5,224,452.52	821,461.85
本期利润	-2,147,710.63	2,376,981.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0137	0.1632
本期加权平均净值利润率	-1.19%	14.06%
本期基金份额净值增长率	-2.51%	-2.60%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	12,392,576.30	14,040.42
期末可供分配基金份额利润	0.0888	0.0853
期末基金资产净值	151,905,907.54	178,650.03
期末基金份额净值	1.089	1.085
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.69%	-5.32%

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；

(4)本基金于2017年9月9日正式转型为财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)，基金份额累计净值增长率自转型日起算。

(5)本基金自2022年3月3日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

## 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

财通多策略升级混合(LOF)A

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	1.02%	1.09%	0.85%	0.48%	0.17%	0.61%
过去三个月	-7.87%	0.95%	-2.20%	0.45%	-5.67%	0.50%
过去六个月	-2.51%	1.00%	0.65%	0.46%	-3.16%	0.54%
过去一年	-6.92%	1.46%	-6.35%	0.54%	-0.57%	0.92%
过去三年	5.93%	1.67%	1.65%	0.66%	4.28%	1.01%
自基金合同生效起至今	11.69%	1.51%	14.42%	0.68%	-2.73%	0.83%

## 财通多策略升级混合(LOF)C

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	1.12%	1.10%	0.85%	0.48%	0.27%	0.62%
过去三个月	-7.82%	0.95%	-2.20%	0.45%	-5.62%	0.50%
过去六个月	-2.60%	1.00%	0.65%	0.46%	-3.25%	0.54%
过去一年	-7.11%	1.47%	-6.35%	0.54%	-0.76%	0.93%
自基金合同生效起至今	-5.32%	1.73%	-6.64%	0.64%	1.32%	1.09%

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×55%+上证国债指数收益率×45%；

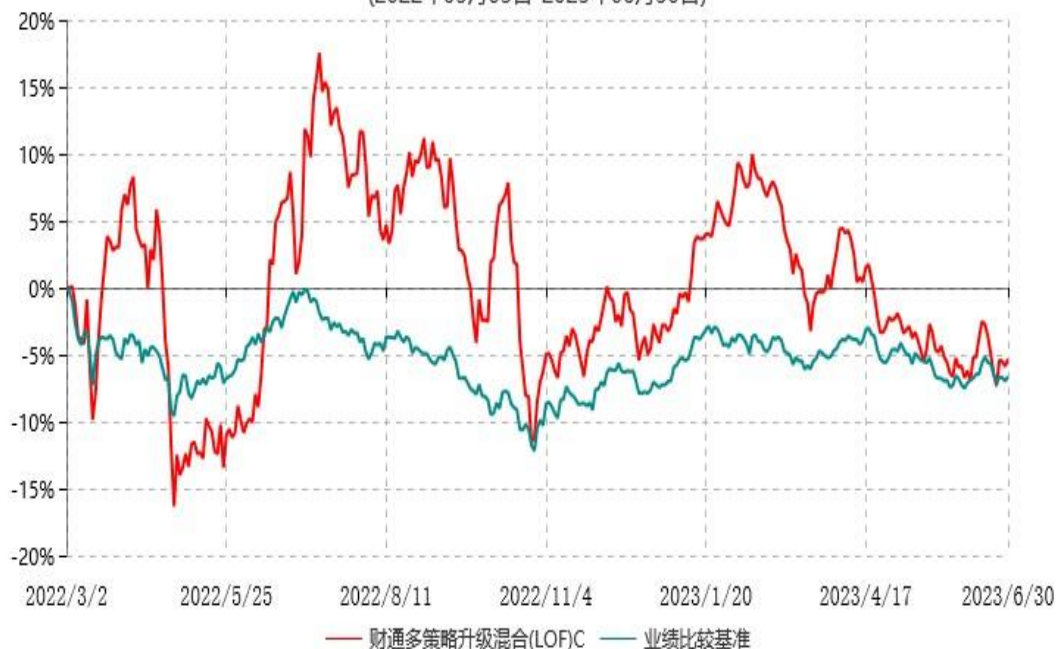
(3)本基金自2022年3月3日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

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

财通多策略升级混合(LOF)A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年09月09日-2023年06月30日)



财通多策略升级混合(LOF)C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年03月03日-2023年06月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2016年3月9日，转型日期为2017年9月9日；  
(2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月，截至建仓期末及本报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求；

(3)本基金自2017年9月8日起根据中国证券投资基金业协会《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发〔2017〕6号)确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整;

(4)本基金自2022年3月3日起增设收取销售服务费的C类份额,原份额变更为A类份额。

## §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		
沈犁	本基金的基金经理	2021-04-14	-	9年	上海交通大学工商管理硕士。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员,

					<p>中国国际金融股份有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司高级研究员，惠理集团高级分析员。</p> <p>2020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助理，现任基金投资部基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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、上市开放式基金。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

上半年消费整体呈现继续恢复的形势，但宏观预期较之前发生一定变化。首先，国内经济在后疫情时代保持复苏势头，但主要集中在服务类消费中，整体消费意愿仍然较为谨慎，政策层面保持年初以来的节奏，对可能以投资驱动增长的方式保持警惕，不鼓励加杠杆的行为，其次，海外需求偏弱、叠加地缘政治冲击，外需开始对经济产生负面影响。基于以上的经济环境，我们减少了与投资拉动经济增长相关的持仓，增加了具有进口替代和渗透率提升前景的消费板块持仓，同时也增加了处于周期底部的高端制造板块。

中长期角度，我们认为中国制造业转型升级的方向不变，政策层面和人才红利有望带来较为明确的产业升级，对内需消费、产业发展和资本市场是积极推动。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通多策略升级混合(LOF)A基金份额净值为1.089元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.51%，同期业绩比较基准收益率为0.65%；截至报告期末，

财通多策略升级混合(LOF)C基金份额净值为1.085元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-2.60%,同期业绩比较基准收益率为0.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年上半年的宏观经济整体呈现恢复的态势,主要受益疫情管控的放开,但市场预期出现一定波折,主要围绕地产下行加大、地缘冲突加剧、外需不足,体现在产业信心不足、消费信心保守。针对这一情况,近期的政治局会议在政策层面及时做出方向性指导,对稳定房地产预期、恢复产业和消费者信心、地方债务化解等关键要点上进行调控,强调“扩大国内需求,发挥消费拉动经济增长的基础性作用”,优化民营经济发展环境,抓住高质量开放,适时调整优化房地产政策”,强调“加大保障性住房建设和供给”防风险与提振信心并举,活跃资本市场。我们认为下半年经济预计保持平稳增长,在国内经济补库存、海外利率见顶、地产政策托底的预期下,市场预计会有积极的表现。

长期角度,高质量发展会是坚持的主要方向,对于过去以投资和加杠杆拉动的经济增长方式预计可能会有所改变,我国的制造业成本和人才优势有望带动内需、产业和资本市场保持健康发展。

#### 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：在封闭期内，本基金不进行收益分配。转换为上市开放式基金(LOF)后，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：财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)

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	10,843,977.81	7,450,800.35
结算备付金		279,641.76	921,275.93
存出保证金		91,086.69	94,311.23
交易性金融资产	6.4.7.2	141,611,466.94	237,148,033.96
其中：股票投资		141,611,466.94	220,267,527.12
基金投资		-	-
债券投资		-	16,880,506.84
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		1,419,214.60	9,773,998.22
应收股利		-	-
应收申购款		43,823.63	278,301.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		154,289,211.43	255,666,721.67
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>



		2023年06月30日	2022年12月31日
<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		1,530,439.00	-
应付赎回款		100,369.49	562,896.57
应付管理人报酬		191,214.88	328,957.92
应付托管费		31,869.14	54,826.35
应付销售服务费		813.34	19,585.15
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	309.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	349,948.01	528,583.46
负债合计		2,204,653.86	1,495,159.14
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	139,677,940.85	227,638,334.38
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	12,406,616.72	26,533,228.15
净资产合计		152,084,557.57	254,171,562.53
负债和净资产总计		154,289,211.43	255,666,721.67

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额139,677,940.85份。其中A类基金份额净值1.089元，份额总额139,513,331.24份；C类基金份额净值1.085元，份额总额164,609.61份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)

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
<b>一、营业总收入</b>		2,113,342.69	12,235,721.91
1.利息收入		23,537.94	29,153.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,537.94	29,153.03
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）		7,767,781.35	8,106,608.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,373,807.51	6,615,166.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,041,600.80	373,898.37
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	352,373.04	1,117,543.48
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	-5,816,643.61	3,774,746.67
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	138,667.01	325,214.05

减：二、营业总支出		1,884,071.93	2,096,862.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,484,481.20	1,657,535.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	247,413.56	276,255.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	36,035.35	60,765.74
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		29.64	2.06
8. 其他费用	6.4.7.17	116,112.18	102,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		229,270.76	10,138,859.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		229,270.76	10,138,859.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		229,270.76	10,138,859.88

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)

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）	227,638,334.38	-	26,533,228.15	254,171,562.53
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）	227,638,334.38	-	26,533,228.15	254,171,562.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-87,960,393.53	-	-14,126,611.43	-102,087,004.96
（一）、综合收益总额	-	-	229,270.76	229,270.76
（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）	-87,960,393.53	-	-14,355,882.19	-102,316,275.72
其中：1.基金申购款	15,180,283.18	-	2,762,016.43	17,942,299.61
2.基金赎回款	-103,140,676.71	-	-17,117,898.62	-120,258,575.33
（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）	139,677,940.85	-	12,406,616.72	152,084,557.57
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）	153,961,567.64	-	19,025,612.33	172,987,179.97
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）	153,961,567.64	-	19,025,612.33	172,987,179.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	98,258,003.22	-	23,694,928.12	121,952,931.34
（一）、综合收益总额	-	-	10,138,859.88	10,138,859.88
（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）	98,258,003.22	-	13,556,068.24	111,814,071.46
其中：1.基金申购款	157,360,828.95	-	22,697,399.71	180,058,228.66
2.基金赎回款	-59,102,825.73	-	-9,141,331.47	-68,244,157.20
（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）	252,219,570.86	-	42,720,540.45	294,940,111.31

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

财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）由财通多策略升级混合型证券投资基金转型而成，财通多策略升级混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]3121号《关于准予财通多策略升级混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2016年3月9日生效，首次募集规模为4,646,865,157.19份基金份额。根据《财通多策略升级混合型证券投资基金基金合同》及《关于财通多策略升级混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)的公告》，本基金自2017年9月9日起转型为上市开放式基金(LOF)并更名为财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)。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为财通基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《财通多策略升级混合型证券投资基金基金合同》及《关于财通多策略升级混合型证券投资基金转换为上市开放式基金(LOF)的公告》，本基金自2017年9月9日起转型为上市开放式基金(LOF)并更名为财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)。

根据基金管理人财通基金管理有限公司于2022年2月26日发布的《财通基金管理有限公司关于财通多策略升级混合型证券投资基金（LOF）增加C类基金份额并修改法律文件的公告》，本基金自2022年3月3日起增加C类基金份额，并对本基金的基金合同作相应修改。本基金原基金份额全部归入A类份额，A类份额不收取销售服务费，且赎回费率与C类份额不同。

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证、债券、中期票据、短期融资券、资产支持

证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产(含存托凭证)比例为基金资产的30%~95%;债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产的0%~70%;在封闭期内,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;转换为上市开放式基金(LOF)后,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 55%+上证国债指数收益率 $\times$ 45%。

#### 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	10,843,977.81

等于：本金	10,842,405.49
加：应计利息	1,572.32
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	10,843,977.81

#### 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	143,671,416.97	-	141,611,466.94	-2,059,950.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	143,671,416.97	-	141,611,466.94	-2,059,950.03

### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 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	-
应付赎回费	333.78
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	251,502.05
其中：交易所市场	251,502.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,112.18
合计	349,948.01

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 财通多策略升级混合(LOF)A

金额单位：人民币元

项目 (财通多策略升级混合(LOF) A)	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	175,955,403.09	175,955,403.09
本期申购	13,694,143.49	13,694,143.49
本期赎回（以“-”号填列）	-50,136,215.34	-50,136,215.34
本期末	139,513,331.24	139,513,331.24

#### 6.4.7.7.2 财通多策略升级混合(LOF)C

金额单位：人民币元

项目 (财通多策略升级混合(LOF) C)	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	51,682,931.29	51,682,931.29
本期申购	1,486,139.69	1,486,139.69
本期赎回（以“-”号填列）	-53,004,461.37	-53,004,461.37
本期末	164,609.61	164,609.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 财通多策略升级混合(LOF)A

单位：人民币元

项目 (财通多策略升级混合 (LOF)A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	41,749,549.04	-21,106,774.28	20,642,774.76
本期利润	5,224,452.52	-7,372,163.15	-2,147,710.63
本期基金份额交易产生的变动数	-10,009,949.33	3,907,461.50	-6,102,487.83
其中：基金申购款	3,772,548.74	-1,301,473.25	2,471,075.49
基金赎回款	-13,782,498.07	5,208,934.75	-8,573,563.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,964,052.23	-24,571,475.93	12,392,576.30

##### 6.4.7.8.2 财通多策略升级混合(LOF)C

单位：人民币元

项目 (财通多策略升级混合 (LOF)C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	12,087,765.12	-6,197,311.73	5,890,453.39
本期利润	821,461.85	1,555,519.54	2,376,981.39
本期基金份额交易产生的变动数	-12,866,192.80	4,612,798.44	-8,253,394.36
其中：基金申购款	403,229.45	-112,288.51	290,940.94
基金赎回款	-13,269,422.25	4,725,086.95	-8,544,335.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,034.17	-28,993.75	14,040.42

#### 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	18,194.20
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	4,462.68
其他	881.06
合计	23,537.94

#### 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	444,400,515.92
减：卖出股票成本总额	438,867,885.26
减：交易费用	1,158,823.15
买卖股票差价收入	4,373,807.51

**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	25,436.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,016,164.62
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	3,041,600.80

**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	45,068,186.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	41,561,657.72
减：应计利息总额	489,618.63
减：交易费用	745.73
买卖债券差价收入	3,016,164.62

**6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

**6.4.7.11.4 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。

**6.4.7.12 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	352,373.04
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	352,373.04

**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	-5,816,643.61
——股票投资	-5,857,214.13
——债券投资	40,570.52
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,816,643.61

**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	138,667.01
合计	138,667.01

**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	29,752.78
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	116,112.18

**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**

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（“财通基金”）	基金管理人、基金销售机构



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
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

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 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	12,216,458.98	1.53%	-	-

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末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 2023年01月01日至2023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	11,254.99	1.73%	-	-

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	1,484,481.20	1,657,535.70
其中：支付销售机构的客户维护费	447,962.72	459,137.21

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 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托管费	247,413.56	276,255.97

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期 2023年01月01日至2023年06月30日

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通多策略升级混合(LOF)A	财通多策略升级混合(LOF)C	合计
财通基金	0.00	20.40	20.40
合计	0.00	20.40	20.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通多策略升级混合(LOF)A	财通多策略升级混合(LOF)C	合计
财通基金	0.00	12.27	12.27
合计	0.00	12.27	12.27

注：(1)本基金A类基金份额不收取销售服务费；

(2)本基金C类基金份额基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.4%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；

(3)本基金C类基金份额销售服务费计提的计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.4%÷当年天数；

(4)本基金自2022年3月3日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

#### 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

财通多策略升级混合(LOF)A

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	12,461,820.04	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	39,001,820.04
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	12,461,820.04	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	39,001,820.04
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	19.58%

## 财通多策略升级混合(LOF)C

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

## 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	10,843,977.81	18,194.20	20,045,199.52	23,694.16

#### 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内均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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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
300118	东方日升	2023-02-10	6个月	非公开发行流通受限	20.15	24.80	248,139	5,000.00	6,153.84	-
601111	中国国航	2023-01-18	6个月	非公开发行流通受限	8.95	8.11	534,409	4,782.96	4,334.05	-

				限						
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	55.00	55.00	688	37,840.00	37,840.00	-
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	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股限售	19.86	18.06	1,086	21,567.96	19,613.16	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	317	7,535.09	13,596.13	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新股限售	30.85	23.63	465	14,345.25	10,987.95	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股限售	11.10	17.04	626	6,948.60	10,667.04	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股限售	23.60	64.67	163	3,846.80	10,541.21	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	386	10,344.80	8,615.52	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股限售	152.38	135.97	58	8,838.04	7,886.26	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6个月	新股限售	37.88	29.49	260	9,848.80	7,667.40	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	新股限售	5.69	5.41	1,380	7,852.20	7,465.80	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	432	7,015.68	7,322.40	-

688562	航天软件	2023-05-15	6个月	新股限售	12.68	22.31	320	4,057.60	7,139.20	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股限售	33.73	31.85	218	7,353.14	6,943.30	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新股限售	41.20	42.69	161	6,633.20	6,873.09	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股限售	135.80	120.41	57	7,740.60	6,863.37	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股限售	26.74	40.68	161	4,305.14	6,549.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	401	4,483.18	5,850.59	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	113	3,955.00	5,788.99	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	228	4,984.08	5,437.80	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股限售	11.88	21.02	256	3,041.28	5,381.12	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	新股限售	14.16	16.21	331	4,686.96	5,365.51	-
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	新股限售	10.68	12.34	421	4,496.28	5,195.14	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	96	4,192.32	5,092.80	-
6885	航天	2023	6个月	新股	21.17	23.50	212	4,48	4,98	-

52	南湖	-05-08		限售				8.04	2.00	
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股限售	29.99	23.79	206	6,177.94	4,900.74	-
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	186	3,571.20	4,748.58	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	新股限售	26.66	31.50	149	3,972.34	4,693.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	44.18	25.10	132	5,831.76	3,313.20	-
301281	科源制药	2023-03-28	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	25.10	53	-	1,330.30	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股限售	125.80	118.03	39	4,906.20	4,603.17	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股限售	30.26	25.33	181	5,477.06	4,584.73	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股限售	19.99	16.90	253	5,057.47	4,275.70	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	77	4,235.00	4,235.00	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	新股限售	20.92	19.16	202	4,225.84	3,870.32	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股限售	73.45	46.64	77	5,655.65	3,591.28	-
688623	双元科技	2023-05-3	6个月	新股限售	125.88	86.79	40	5,035.20	3,471.60	-



		1								
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股限售	33.99	29.49	117	3,976.83	3,450.33	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	114	2,881.92	3,405.18	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股限售	17.80	17.89	178	3,168.40	3,184.42	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股限售	10.36	11.84	219	2,268.84	2,592.96	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股限售	11.66	12.26	192	2,238.72	2,353.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股限售	15.90	17.09	134	2,130.60	2,290.06	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股限售	15.38	14.87	116	1,784.08	1,724.92	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股限售	25.98	24.53	54	1,402.92	1,324.62	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股限售	44.48	39.48	22	978.56	868.56	-

#### 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。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人中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在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	10,843,977.81	-	-	-	-	-	10,843,977.81
结算备付金	279,641.76	-	-	-	-	-	279,641.76
存出保证金	91,086.69	-	-	-	-	-	91,086.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	141,611,466.94	141,611,466.94
应收清算款	-	-	-	-	-	1,419,214.60	1,419,214.60
应收申购款	-	-	-	-	-	43,823.63	43,823.63

资产总计	11,214,706.26	-	-	-	-	143,074,505.17	154,289,211.43
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	1,530,439.00	1,530,439.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	100,369.49	100,369.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	191,214.88	191,214.88
应付托管费	-	-	-	-	-	31,869.14	31,869.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	813.34	813.34
其他负债	-	-	-	-	-	349,948.01	349,948.01
负债总计	-	-	-	-	-	2,204,653.86	2,204,653.86
利率敏感度缺口	11,214,706.26	-	-	-	-	140,869,851.31	152,084,557.57
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	7,450,800.35	-	-	-	-	-	7,450,800.35
结算备付金	921,275.93	-	-	-	-	-	921,275.93

存出保证金	94,311.23	-	-	-	-	-	94,311.23
交易性金融资产	-	-	1,316,693.07	15,563,813.77	-	220,267,527.12	237,148,033.96
应收清算款	-	-	-	-	-	9,773,998.22	9,773,998.22
应收申购款	-	-	-	-	-	278,301.98	278,301.98
资产总计	8,466,387.51	-	1,316,693.07	15,563,813.77	-	230,319,827.32	255,666,721.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	562,896.57	562,896.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	328,957.92	328,957.92
应付托管费	-	-	-	-	-	54,826.35	54,826.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	19,585.15	19,585.15
应交税费	-	-	-	-	-	309.69	309.69
其他负债	-	-	-	-	-	528,583.46	528,583.46
负债总计	-	-	-	-	-	1,495,159.14	1,495,159.14
利率敏感度缺口	8,466,387.51	-	1,316,693.07	15,563,813.77	-	228,824,668.18	254,171,562.53

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

假设	1.市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响，对其他会计科目的影响可忽略。		
假设	2.基金组合对利率的风险暴露，根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到，债券凸性对组合净值的影响可忽略。		
假设	3.市场即期利率曲线平行变动。		
假设	4.基金组合构成和其他市场变量保持不变。		
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
	市场利率下降25个基点	-	1,030.64
	市场利率上升25个基点	-	-1,030.64

注：本基金本期末未持有交易性固定收益类投资（不含可转换债券及可交换债券），且持有的银行存款均为活期存款，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，股票投资比例（含存托凭证）为基金资产的30%~95%，债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产的0%~70%，在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金(LOF)后，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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	141,611,466.94	93.11	220,267,527.12	86.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	16,880,506.84	6.64
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	141,611,466.94	93.11	237,148,033.96	93.30

#### 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%	2,103,146.52	3,600,946.31
	业绩比较基准减少1%	-2,103,146.52	-3,600,946.31

#### 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	130,799,636.93	222,747,983.81
第二层次	37,840.00	1,316,693.07
第三层次	10,773,990.01	13,083,357.08
合计	141,611,466.94	237,148,033.96

###### 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	141,611,466.94	91.78
	其中：股票	141,611,466.94	91.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,123,619.57	7.21
8	其他各项资产	1,554,124.92	1.01
9	合计	154,289,211.43	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,037,685.00	1.34
B	采矿业	-	-
C	制造业	130,974,495.12	86.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	4,643.98	0.00
F	批发和零售业	12,703.52	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,334,056.99	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,207,069.35	2.77
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,365.51	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	141,611,466.94	93.11

### 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	600872	中炬高新	364,700	13,417,313.00	8.82
2	603225	新凤鸣	1,185,750	13,102,537.50	8.62
3	603605	珀莱雅	113,220	12,725,928.00	8.37
4	601233	桐昆股份	712,600	9,441,950.00	6.21
5	603983	丸美股份	286,400	9,265,040.00	6.09
6	002271	东方雨虹	290,200	7,910,852.00	5.20
7	600079	人福医药	291,374	7,849,615.56	5.16
8	300408	三环集团	249,500	7,322,825.00	4.81
9	300661	圣邦股份	81,380	6,683,739.40	4.39
10	301101	明月镜片	159,796	6,556,429.88	4.31
11	300118	东方日升	248,139	6,153,847.20	4.05
12	603235	天新药业	148,600	4,660,096.00	3.06
13	601111	中国国航	534,409	4,334,056.99	2.85
14	605499	东鹏饮料	25,000	4,322,500.00	2.84
15	002215	诺普信	518,500	3,893,935.00	2.56
16	688045	必易微	67,523	3,848,811.00	2.53
17	600200	江苏吴中	498,200	3,592,022.00	2.36
18	603711	香飘飘	174,000	3,572,220.00	2.35
19	688526	科前生物	146,975	3,496,535.25	2.30
20	603707	健友股份	176,800	2,386,800.00	1.57
21	603477	巨星农牧	61,100	2,037,685.00	1.34
22	300285	国瓷材料	67,800	1,857,720.00	1.22
23	002832	比音勒芬	28,900	1,023,349.00	0.67
24	688212	澳华内镜	5,953	404,208.70	0.27
25	688052	纳芯微	1,674	265,111.38	0.17
26	688172	燕东微	8,196	194,900.88	0.13
27	300952	恒辉安防	7,700	173,712.00	0.11
28	603379	三美股份	5,700	134,007.00	0.09
29	688576	西山科技	951	125,819.01	0.08

30	688062	迈威生物	5,613	120,847.89	0.08
31	001215	千味央厨	1,500	99,735.00	0.07
32	603986	兆易创新	700	74,375.00	0.05
33	688582	芯动联科	1,602	74,060.33	0.05
34	688620	安凯微	4,203	55,949.58	0.04
35	688429	时创能源	1,860	53,210.88	0.03
36	688095	福昕软件	363	45,875.94	0.03
37	688603	天承科技	765	42,075.00	0.03
38	688631	莱斯信息	1,136	36,681.50	0.02
39	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.02
40	688249	晶合集成	1,086	19,613.16	0.01
41	301358	湖南裕能	317	13,596.13	0.01
42	301260	格力博	465	10,987.95	0.01
43	688472	阿特斯	626	10,667.04	0.01
44	688361	中科飞测	163	10,541.21	0.01
45	301303	真兰仪表	386	8,615.52	0.01
46	688531	日联科技	58	7,886.26	0.01
47	688443	智翔金泰	260	7,667.40	0.01
48	688469	中芯集成	1,380	7,465.80	0.00
49	301408	华人健康	432	7,322.40	0.00
50	688562	航天软件	320	7,139.20	0.00
51	301373	凌玮科技	218	6,943.30	0.00
52	301141	中科磁业	161	6,873.09	0.00
53	688593	新相微	401	5,850.59	0.00
54	688535	华海诚科	113	5,788.99	0.00
55	688523	航天环宇	228	5,437.80	0.00
56	001287	中电港	256	5,381.12	0.00
57	688334	西高院	331	5,365.51	0.00
58	688543	国科军工	96	5,092.80	0.00
59	688552	航天南湖	212	4,982.00	0.00
60	301386	未来电器	206	4,900.74	0.00

61	688433	华曙高科	149	4,693.50	0.00
62	301281	科源制药	185	4,643.50	0.00
63	688581	安杰思	39	4,603.17	0.00
64	688570	天玛智控	181	4,584.73	0.00
65	301439	泓淋电力	253	4,275.70	0.00
66	688512	慧智微	202	3,870.32	0.00
67	301345	涛涛车业	77	3,591.28	0.00
68	688623	双元科技	40	3,471.60	0.00
69	688479	友车科技	117	3,450.33	0.00
70	603135	中重科技	178	3,184.42	0.00
71	601065	江盐集团	219	2,592.96	0.00
72	601133	柏诚股份	192	2,353.92	0.00
73	603137	恒尚节能	134	2,290.06	0.00
74	001360	南矿集团	116	1,724.92	0.00
75	603125	常青科技	54	1,324.62	0.00
76	001367	海森药业	22	868.56	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	603369	今世缘	18,803,821.00	7.40
2	603983	丸美股份	17,835,805.00	7.02
3	603605	珀莱雅	15,727,713.36	6.19
4	601233	桐昆股份	15,225,037.00	5.99
5	000799	酒鬼酒	14,865,467.00	5.85
6	002567	唐人神	14,300,842.00	5.63
7	603737	三棵树	13,251,792.00	5.21
8	600872	中炬高新	12,764,669.00	5.02
9	603477	巨星农牧	12,629,049.00	4.97

10	600809	山西汾酒	12,112,248.20	4.77
11	600559	老白干酒	11,383,215.00	4.48
12	688141	杰华特	8,947,053.28	3.52
13	600702	舍得酒业	8,512,806.00	3.35
14	301101	明月镜片	8,064,534.00	3.17
15	000568	泸州老窖	8,021,722.00	3.16
16	603259	药明康德	7,793,926.00	3.07
17	300408	三环集团	7,560,607.96	2.97
18	002271	东方雨虹	7,398,511.00	2.91
19	300661	圣邦股份	7,372,912.16	2.90
20	603711	香飘飘	7,132,415.20	2.81
21	688212	澳华内镜	6,737,007.70	2.65
22	600731	湖南海利	6,436,247.20	2.53
23	600079	人福医药	5,137,053.00	2.02

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	002567	唐人神	36,984,040.56	14.55
2	603477	巨星农牧	29,814,245.54	11.73
3	000568	泸州老窖	21,843,454.00	8.59
4	300498	温氏股份	20,954,176.29	8.24
5	000799	酒鬼酒	20,684,438.00	8.14
6	300871	回盛生物	19,428,405.30	7.64
7	603369	今世缘	18,378,846.00	7.23
8	002271	东方雨虹	15,214,664.00	5.99
9	603363	傲农生物	14,548,525.00	5.72
10	600872	中炬高新	13,598,194.00	5.35
11	603737	三棵树	12,158,214.65	4.78

12	002548	金新农	12,082,408.54	4.75
13	600809	山西汾酒	11,844,957.00	4.66
14	600559	老白干酒	10,415,951.90	4.10
15	600388	ST龙净	10,145,223.00	3.99
16	603566	普莱柯	9,928,594.00	3.91
17	603225	新凤鸣	9,509,021.00	3.74
18	003000	劲仔食品	9,446,497.00	3.72
19	688212	澳华内镜	9,402,691.13	3.70
20	600702	舍得酒业	8,831,176.00	3.47
21	000819	岳阳兴长	8,768,925.00	3.45
22	688141	杰华特	8,676,436.37	3.41
23	603259	药明康德	7,851,769.00	3.09
24	603983	丸美股份	6,587,524.00	2.59
25	600079	人福医药	5,990,500.00	2.36
26	600731	湖南海利	5,817,120.10	2.29

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	366,069,039.21
卖出股票收入（成交）总额	444,400,515.92

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。



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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 7.11.2 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人福医药（证券代码：600079.SH）发行主体人福医药集团股份公司及其控股股东武汉当代科技产业集团股份有限公司、实际控制人艾路明在信息披露、规范运作等方面，有关责任人在职责履行方面因存在多项违规行为受到纪律处分。

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	91,086.69
2	应收清算款	1,419,214.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	43,823.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,554,124.92

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末无前十名股票中存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因, 本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	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
财通多策略升级混合(LOF)A	8,684	16,065.56	6,900,949.14	4.9464%	132,612,382.10	95.0536%
财通多策略升级混合(LOF)C	73	2,254.93	63,740.65	38.7223%	100,868.96	61.2777%
合计	8,757	15,950.43	6,964,689.79	4.9862%	132,713,251.06	95.0138%

注：基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	姬蕾	3,000,135.00	9.56%
2	富远网络科技（上海）有限公司	1,248,100.00	3.98%
3	潘海燕	800,613.00	2.55%
4	劳祥娇	800,613.00	2.55%
5	劳祥欢	800,613.00	2.55%
6	柯茹云	627,855.00	2.00%

7	何月珍	608,300.00	1.94%
8	无锡泛舟兄弟工程顾问有限公司	501,557.00	1.60%
9	邓婷	500,000.00	1.59%
10	林祥勋	494,386.00	1.57%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	财通多策略升级混合(LOF)A	101,157.65	0.0725%
	财通多策略升级混合(LOF)C	-	-
	合计	101,157.65	0.0724%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	财通多策略升级混合(LOF)A	0~10
	财通多策略升级混合(LOF)C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	财通多策略升级混合(LOF)A	0
	财通多策略升级混合(LOF)C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通多策略升级混合(L OF)A	财通多策略升级混合(L OF)C
基金合同生效日(2016年03月09日)基金份额总额	4,646,865,157.19	-
本报告期期初基金份额总额	175,955,403.09	51,682,931.29
本报告期基金总申购份额	13,694,143.49	1,486,139.69
减:本报告期基金总赎回份额	50,136,215.34	53,004,461.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	139,513,331.24	164,609.61

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、本报告期内,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，未发生托管人及其高级管理人员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	8,043,827.96	1.01%	5,802.15	0.89%	-
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	12,216,458.98	1.53%	11,254.99	1.73%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	9,131,997.57	1.14%	6,586.82	1.01%	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	15,426,864.50	1.93%	11,281.10	1.73%	-
东方财富	2	25,765,343.29	3.23%	18,842.90	2.89%	-

证券 股份 有限 公司						
东方 证券	2	16,630,212.16	2.09%	12,161.25	1.87%	-
东海 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	-	-	-	-	-
高华 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
国海 证券	2	47,075,809.30	5.90%	34,428.00	5.29%	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国联 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 君安	2	65,282,164.00	8.19%	47,501.76	7.30%	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
国元 证券	2	35,985,033.71	4.51%	33,512.98	5.15%	-
海通 证券	2	-	-	-	-	-
华创 证券	2	8,553,084.00	1.07%	6,254.38	0.96%	-
华福 证券	2	-	-	-	-	-
华融 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
江海 证券	2	-	-	-	-	-
开源	2	34,240,046.69	4.29%	24,941.01	3.83%	-

证券						
联讯 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	70,582,736.17	8.85%	51,423.50	7.90%	-
民族 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
山西 证券	2	-	-	-	-	-
申港 证券	2	16,073,917.96	2.02%	11,650.06	1.79%	-
申银 万国	2	124,120,712.33	15.56%	115,590.64	17.76%	-
太平 洋证 券	2	2,226,571.00	0.28%	1,628.30	0.25%	-
天风 证券	2	2,544,441.00	0.32%	2,344.16	0.36%	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
西南 证券	2	-	-	-	-	-
湘财 证券	2	88,446,027.16	11.09%	81,485.66	12.52%	-
信达 证券	2	16,110,474.19	2.02%	11,620.37	1.78%	-
银河 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	4,925,414.65	0.62%	4,586.67	0.70%	-
浙商 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中投 证券	2	-	-	-	-	-
中金 公司	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	44,978,911.61	5.64%	32,443.56	4.98%	-



中信证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	4	11,183,398.57	1.40%	8,137.90	1.25%	-
广发证券	4	85,778,168.60	10.76%	79,793.33	12.26%	-
兴业证券	4	25,863,701.44	3.24%	18,655.93	2.87%	-
中信建投证券	4	26,379,084.85	3.31%	19,101.36	2.93%	-

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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	1,201,236.00	1.73%	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	25,138,459.05	36.29%	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	1,600,000.00	2.31%	-	-	-	-	-	-	-
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	7,152,490.67	10.32%	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	2,200,124.00	3.18%	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	4,101,938.00	5.92%	-	-	-	-	-	-
申银万国	18,947,093.22	27.35%	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	5,836,137.48	8.42%	-	-	-	-	-	-
广发证券	3,099,578.00	4.47%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-20
5	财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2022年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-21
6	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
7	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2023-02-14
8	关于上海爱建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	2023-03-22
9	财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-30
10	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
11	财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-22
12	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
13	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
14	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

	告		
15	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
16	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
17	财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)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
18	财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)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、中国证监会准予基金募集的文件；
- 2、财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)基金合同；
- 3、财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)托管协议；
- 4、财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)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