

财通资管价值发现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:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2021 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月24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01月01日起至06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	5
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	6
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56

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	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管价值发现混合型证券投资基金
基金简称	财通资管价值发现混合
基金主代码	008276
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年03月23日
基金管理人	财通证券资产管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	210,431,564.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选个券。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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		财通证券资产管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	刘泉	秦一楠
	联系电话	021-20568203	010-66060069

人	电子邮箱	lq@ctzg.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95336	95599
传真		021-68753502	010-68121816
注册地址	浙江省杭州市上城区白云路26号143室	北京市东城区建国门内大街69号	
办公地址	上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9	
邮政编码		200122	100031
法定代表人		马晓立	谷澍

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.ctzg.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通证券资产管理有限公司	浙江省杭州市上城区四宜路22号四宜大院B幢

§ 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	80,935,707.08
本期利润	69,108,885.21
加权平均基金份额本期利润	0.2956

本期加权平均净值利润率	17.34%
本期基金份额净值增长率	20.34%
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	155,895,175.07
期末可供分配基金份额利润	0.7408
期末基金资产净值	418,429,360.77
期末基金份额净值	1.9884
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	98.84%

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	6.77%	1.22%	-1.32%	0.52%	8.09%	0.70%
过去三个月	22.86%	1.11%	2.47%	0.64%	20.39%	0.47%
过去六个月	20.34%	1.40%	0.62%	0.86%	19.72%	0.54%
过去一年	64.10%	1.51%	16.38%	0.86%	47.72%	0.65%
自基金合同 生效起至今	98.84%	1.39%	26.52%	0.83%	72.32%	0.56%

注：1、业绩比较基准：沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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、本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月，本基金已建仓完毕。截至建仓期结束，各项资产配置比例符合本基金基金合同约定。

2、自基金合同生效至报告期末，财通资管价值发现混合基金份额净值增长率为98.84%，同期业绩比较基准收益率为26.52%。

§ 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

财通证券资产管理有限公司系财通证券股份有限公司的全资子公司，注册资本2亿元人民币。2015年12月，公司获准开展公开募集证券投资基金管理业务。截至2021年6月30日，公司共管理29只基金，分别为财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿

益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管价值发现混合型证券投资基金、财通资管行业精选混合型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金、财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管睿慧1年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金和财通资管鸿安30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金。

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		
姜永明	本基金基金经理、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金和财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金基金经理。公司总经理助理兼权益投资总监。	2020-03-23	-	11	清华大学工商管理硕士。2009年7月加入平安资产管理有限责任公司，历任行业研究员、股票投资经理、股票投资部负责人、股票投决会委员；2018年12月加入财通证券资产管理有限公司，担任公司总经理助理兼权益投资总监。
朱旭芬	本基金基金经理助理、财通资管消费精选灵活配置	2020-12-16	-	5	北京大学软件工程硕士。2016年1月起加入财通证券

	混合型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管行业精选混合型证券投资基金、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金和财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金基金经理助理。				资产管理有限公司，历任战略产品部产品经理助理、权益研究部产品经理，现任权益公募投资部基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管价值发现混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易场所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

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年上半年，我国经济持续复苏，权益市场也在震荡中小幅上行。具体来看，上半年市场行情主要分为三个阶段，春节前，国内经济复苏向好，叠加开年基金发行热潮、市场对于春季躁动行情的期待推动市场风险偏好提升，A股迎来开门红；春节后，美债利率快速上行触发市场调整，一轮快速下跌之后国内市场持续震荡，这一阶段股市走势偏弱的主要原因，除了美债利率引发的估值调整外，还包括经济数据略低于预期，且通胀预期高企；进入5月中下旬，多重因素催生市场迎来新一轮阶段性上涨，国常会多次强调将会使用各种方法调整大宗商品的上涨趋势，螺纹钢、动力煤为代表的中国定价的大宗商品价格开始疲软，叠加猪价下跌，通胀压力有所缓解，同时央行对流动性有所呵护，且随后尽管市场利率有所下行，但流动性边际宽松的方向依旧，此外美国4月、5月非农就业数据均低于预期，海外市场紧缩担忧也有所缓解，进一步提振了全球市场风险偏好。从行业表现来看，市场分化依然明显，28个申万一级行业多数收涨，其中电气设备、钢铁、化工实现20%以上收益，领涨其他行业，农林牧渔、房地产、国防军工、非银金融、家用电器跌幅则相对靠前。

报告期内，本基金继续采用GARP策略，兼顾价值和成长，行业配置适度均衡，重点配置了计算机、通信、新能源、新材料、食品饮料、休闲服务、创新药、医疗服务等行业优质标的，阶段性地参与了化工等周期相关标的，组合实现较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管价值发现混合基金份额净值为1.9884元，本报告期内，基金份额净值增长率为20.34%，同期业绩比较基准收益率为0.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年全球供需缺口引领我国出口走强，叠加房地产销售投资表现强劲，经济快速修复。进入下半年，我们认为经济动能或环比衰减，目前经济中比较强势的支撑项出口，随着国外疫情逐步控制，其经济恢复将更多来自服务业消费而非耐用品消费，自身供需矛盾也将进一步缓和，当前出口强势的局面可能较难长时间维持，此外国内疫情防控常态化背景下，居民生活半径收缩，消费的改善注定是一个渐进过程，从当前各项经济数据来看，呈现出温和放缓态势。

从流动性来看，在经济放缓、通胀相对可控的背景下，我们认为市场流动性仍有望维持合理充裕。一方面，上半年由于房地产与个人信贷的控制、债券发行放缓、非标进一步压降等方面的原因，社会融资存量增速从2月的13.3%快速下行至6月的11.0%，由于已经接近名义GDP 增速，稳定宏观杠杆率目标基本实现，预计社融下半年降幅将趋缓。另一方面，在当前消费受疫情影响仍弱于正常水平、上游价格上涨压力向CPI传导不顺畅的背景下，叠加猪价下跌，CPI有望保持相对温和，对货币政策收紧的约束不强。

综上，我们对下一阶段A股市场仍然持谨慎乐观的态度，三季度可能指数震荡，市场以结构性机会为主，四季度到明年上半年，随着经济下行重新宽松，有望迎来指数行情。结构上，随着经济复苏放缓，更多资金可能逐步转移到具备高行业景气度的成长板块，管理人会对业绩景气板块、科技成长板块等保持密切关注。组合管理上，我们预计保持中性偏高仓位进行操作，行业配置适度均衡化以降低组合波动，精选产业前景明朗、行业地位突出、经营管理优秀的优质标的进行配置，通过分享企业长期内生增长价值实现组合净值的稳步增长。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人设有估值工作小组，估值工作小组成员由公司分管高管、研究及投资部门、合规稽核部、风险管理部、运营保障部等人员组成。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内无利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—财通证券资产管理有限公司2021年1月1日至2021年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，财通证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，财通证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：财通资管价值发现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	49,110,933.28	53,661,718.31
结算备付金		221,084.38	388,985.91
存出保证金		129,334.75	249,068.34
交易性金融资产	6.4.7.2	369,917,637.39	421,447,590.23
其中：股票投资		364,028,062.98	413,928,342.97
基金投资		-	-
债券投资		5,889,574.41	7,519,247.26
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		416,383.36	-
应收利息	6.4.7.5	19,281.05	20,920.64
应收股利		-	-
应收申购款		2,170,513.95	912,956.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		421,985,168.16	476,681,239.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		750,697.82	6,472,165.31
应付赎回款		1,929,131.45	9,143,914.14
应付管理人报酬		481,026.21	567,273.10
应付托管费		80,171.04	94,545.51

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	224,656.90	341,873.97
应交税费		60.89	62.36
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,063.08	167,524.71
负债合计		3,555,807.39	16,787,359.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	210,431,564.11	278,329,566.44
未分配利润	6.4.7.10	207,997,796.66	181,564,314.43
所有者权益合计		418,429,360.77	459,893,880.87
负债和所有者权益总计		421,985,168.16	476,681,239.97

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.9884元，基金份额总额210,431,564.11份。

6.2 利润表

会计主体：财通资管价值发现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03月23日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
一、收入		73,692,540.70	56,044,335.65
1. 利息收入		148,672.71	261,159.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	136,234.64	261,159.52
债券利息收入		12,438.07	-
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）		84,589,005.27	22,906,090.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	84,093,530.68	21,222,293.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-263,420.39	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	758,894.98	1,683,797.86
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-11,826,821.87	32,084,341.77
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	781,684.59	792,743.38
减：二、费用		4,583,655.49	2,426,382.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	2,978,691.48	1,149,360.91
2. 托管费	6.4.10.2. 2	496,448.51	191,560.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,004,536.80	1,021,519.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		44.61	-
7. 其他费用	6.4.7.19	103,934.09	63,941.66
三、利润总额（亏损总额		69,108,885.21	53,617,953.20

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		69,108,885.21	53,617,953.20

注：本基金合同生效日为2020年03月23日，上年度可比期间为2020年03月23日至2020年06月30日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管价值发现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）	278,329,566.44	181,564,314.43	459,893,880.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	69,108,885.21	69,108,885.21
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）	-67,898,002.33	-42,675,402.98	-110,573,405.31
其中：1. 基金申购款	102,320,355.20	73,546,532.74	175,866,887.94
2. 基金赎回款	-170,218,357.53	-116,221,935.72	-286,440,293.25
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）	210,431,564.11	207,997,796.66	418,429,360.77

项 目	上年度可比期间		
	2020年03月23日（基金合同生效日）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）	323,361,874.08	-	323,361,874.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,617,953.20	53,617,953.20
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）	-61,485,217.65	1,818,803.46	-59,666,414.19
其中：1. 基金申购款	129,373,720.86	16,797,617.37	146,171,338.23
2. 基金赎回款	-190,858,938.51	-14,978,813.91	-205,837,752.42
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）	261,876,656.43	55,436,756.66	317,313,413.09

注：本基金合同生效日为2020年03月23日，上年度可比期间为2020年03月23日至2020年06月30日。

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：

钱慧

刘博

刘博

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

财通资管价值发现混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019]1832号《关于准予财通资管价值发现混合型证券投资基金注册的批复》核准,由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币323,256,675.58元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0200号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为323,361,874.08份基金份额,其中认购资金利息折合105,198.50份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、同业存单、股指期货、国债期货、货币市场工具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)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为45%-90%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 $\times$ 65%+中债综合指数收益率 $\times$ 35%。

本财务报表由本基金的基金管理人财通证券资产管理有限公司于2021年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金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、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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	49,110,933.28
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	49,110,933.28

注: 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

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	310,080,261.32	364,028,062.98	53,947,801.66
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券 交易所市场	5,174,615.96	5,889,574.41	714,958.45

	银行间市场	-	-	-
	合计	5,174,615.96	5,889,574.41	714,958.45
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		315,254,877.28	369,917,637.39	54,662,760.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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从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	8,614.55
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	89.55
应收债券利息	10,524.57
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	-
应收出借证券利息	-

其他	52.38
合计	19,281.05

注：其他包括应收保证金利息。

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	224,656.90
银行间市场应付交易费用	—
合计	224,656.90

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,260.52
应付证券出借违约金	—
预提费用	88,802.56
合计	90,063.08

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	278,329,566.44	278,329,566.44
本期申购	102,320,355.20	102,320,355.20

本期赎回（以“-”号填列）	-170,218,357.53	-170,218,357.53
本期末	210,431,564.11	210,431,564.11

注：申购含转换入份额，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	112,164,968.49	69,399,345.94	181,564,314.43
本期利润	80,935,707.08	-11,826,821.87	69,108,885.21
本期基金份额交易产生的变动数	-37,205,500.50	-5,469,902.48	-42,675,402.98
其中：基金申购款	60,242,383.25	13,304,149.49	73,546,532.74
基金赎回款	-97,447,883.75	-18,774,051.97	-116,221,935.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	155,895,175.07	52,102,621.59	207,997,796.66

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	131,176.81
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	3,756.35
其他	1,301.48
合计	136,234.64

注：其他包括存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	415,359,120.42
减：卖出股票成本总额	331,265,589.74
买卖股票差价收入	84,093,530.68

6.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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	-263,420.39
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	-263,420.39

6.4.7.13.2 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	15,997,161.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,229,752.55
减：应收利息总额	30,829.29
买卖债券差价收入	-263,420.39

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.15 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	758,894.98
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	758,894.98

6.4.7.16 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	-11,826,821.87
——股票投资	-13,710,033.93
——债券投资	1,883,212.06
——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	-11,826,821.87

6.4.7.17 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	779,233.00
转换费收入	2,451.59
合计	781,684.59

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	1,004,536.80
银行间市场交易费用	—
合计	1,004,536.80

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	10,631.53
帐户维护费	9,000.00
合计	103,934.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
财通证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
财通证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构

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03月23日（基金合同生效日） 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 股份有限 公司	-	-	43,870,518.47	5.10%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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
财通证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年03月23日（基金合同生效日）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
财通证券股份有限公司	18,920.31	3.07%	-	-

注：1. 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。

2. 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等。

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03月23日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,978,691.48	1,149,360.91
其中：支付销售机构的客户维护费	602,997.76	549,855.79

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以1.50%的管理费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年03月23日（基金合同生 效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	496,448.51	191,560.14

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以0.25%的托管费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

份额单位：份

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03月23日（基金 合同生效日）至2020年0 6月30日
基金合同生效日（2020年03月23日）持有的基金份额	-	9,999,000.00
报告期初持有的基金份额	9,999,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	3,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	6,999,000.00	9,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.33%	3.82%

注：基金管理人在本报告期赎回本基金的交易委托财通证券资产管理有限公司直销办理，适用费率参照《财通资管价值发现混合型证券投资基金招募说明书》的约定执行。

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。

6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年03月23日（基金合同生效日） 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
中国农业银行股份有限公司	49,110,933.28	131,176.81	44,622,977.70	249,703.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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
600754	锦江酒店	2021-03-23	2021-09-22	非公开发行限售	44.60	54.68	271,752	12,120,139.20	14,859,399.36	-
688613	奥精医疗	2021-05-13	2021-11-22	新股流通受限	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688625	呈和科技	2021-05-31	2021-12-07	新股流通受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688109	品茗股份	2021-03-22	2021-09-30	新股流通受限	50.05	72.10	1,301	65,115.05	93,802.10	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
3009	贝泰	2021	2021	新股	47.3	251.	299	14,1	75,3	-

57	妮	-03-18	-09-27	流通受限	3	96		51.67	36.04	
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	新股流通受限	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股流通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	新股流通受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	48.59	90.39	348	16,909.32	31,455.72	-
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
3009	震裕	2021	2021	新股	28.7	99.8	240	6,90	23,9	-

53	科技	-03-11	-09-22	流通受限	7	5		4.80	64.00	
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
3009	欢乐	2021	2021	新股	4.94	13.0	928	4,58	12,1	-

97	家	-05- 26	-12- 02	流通 受限		5		4.32	10.4 0	
3009 33	中辰 股份	2021 -01- 15	2021 -07- 22	新股 流通 受限	3.37	10.4 4	1,112	3,74 7.44	11,6 09.2 8	-
3010 02	崧盛 股份	2021 -05- 27	2021 -12- 07	新股 流通 受限	18.7 1	57.6 2	201	3,76 0.71	11,5 81.6 2	-
6052 87	德才 股份	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4 4	11,0 14.4 4	-
3009 56	英力 股份	2021 -03- 16	2021 -09- 27	新股 流通 受限	12.8 5	25.8 0	371	4,76 7.35	9,57 1.80	-
3009 62	中金 辐照	2021 -03- 29	2021 -10- 11	新股 流通 受限	3.40	16.3 7	576	1,95 8.40	9,42 9.12	-
3009 52	恒辉 安防	2021 -03- 03	2021 -09- 13	新股 流通 受限	11.7 2	27.0 8	340	3,98 4.80	9,20 7.20	-
3010 16	雷尔 伟	2021 -06- 23	2021 -12- 30	新股 流通 受限	13.7 5	32.9 8	275	3,78 1.25	9,06 9.50	-
3009 66	共同 药业	2021 -03- 31	2021 -10- 11	新股 流通 受限	8.24	31.5 4	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
3009 45	曼卡 龙	2021 -02- 03	2021 -08- 10	新股 流通 受限	4.56	18.8 8	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-
3009 48	冠中 生态	2021 -02- 18	2021 -08- 25	新股 流通 受限	8.67	27.4 2	324	2,80 8.00	8,88 4.08	-
3009	通用	2021	2021	新股	4.31	13.1	672	2,89	8,80	-

31	电梯	-01- 13	-07- 21	流通 受限		1		6.32	9.92	
3009 50	德固 特	2021 -02- 24	2021 -09- 03	新股 流通 受限	8.41	39.1 3	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-
6051 62	新中 港	2021 -06- 29	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,35 8.39	8,35 8.39	-
3009 58	建工 修复	2021 -03- 18	2021 -09- 29	新股 流通 受限	8.53	27.2 2	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
3009 86	志特 新材	2021 -04- 21	2021 -11- 01	新股 流通 受限	14.7 9	30.5 7	264	3,90 4.56	8,07 0.48	-
3009 87	川网 传媒	2021 -04- 28	2021 -11- 11	新股 流通 受限	6.79	26.8 1	301	2,04 3.79	8,06 9.81	-
3009 78	东箭 科技	2021 -04- 15	2021 -10- 26	新股 流通 受限	8.42	13.6 0	593	4,99 3.06	8,06 4.80	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 07	新股 流通 受限	10.7 6	22.2 0	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
3009 30	屹通 新材	2021 -01- 13	2021 -07- 21	新股 流通 受限	13.1 1	24.4 8	322	4,22 1.42	7,88 2.56	-
3009 85	致远 新能	2021 -04- 21	2021 -10- 29	新股 流通 受限	24.9 0	24.8 1	295	7,34 5.50	7,31 8.95	-
3009 71	博亚 精工	2021 -04- 07	2021 -10- 15	新股 流通 受限	18.2 4	28.2 9	245	4,46 8.80	6,93 1.05	-
3010	嘉益	2021	2021	新股	7.81	21.9	312	2,43	6,84	-

04	股份	-06- 18	-12- 27	流通 受限		4		6.72	5.28	
3009 91	创益 通	2021 -05- 12	2021 -11- 22	新股 流通 受限	13.0 6	26.5 1	254	3,31 7.24	6,73 3.54	-
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	新股 流通 受限	13.3 9	30.1 0	217	2,90 5.63	6,53 1.70	-
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 07	新股 流通 受限	8.29	8.29	782	6,48 2.78	6,48 2.78	-
3009 75	商络 电子	2021 -04- 14	2021 -10- 21	新股 流通 受限	5.48	13.0 3	492	2,69 6.16	6,41 0.76	-
3009 63	中洲 特材	2021 -03- 30	2021 -10- 11	新股 流通 受限	12.1 3	22.4 9	283	3,43 2.79	6,36 4.67	-
3009 43	春晖 智控	2021 -02- 03	2021 -08- 10	新股 流通 受限	9.79	23.0 1	255	2,49 6.45	5,86 7.55	-
3009 72	万辰 生物	2021 -04- 08	2021 -10- 19	新股 流通 受限	7.19	12.6 5	430	3,09 1.70	5,43 9.50	-
3009 29	华骐 环保	2021 -01- 12	2021 -07- 20	新股 流通 受限	13.8 7	29.5 5	183	2,53 8.21	5,40 7.65	-
3009 60	通业 科技	2021 -03- 22	2021 -09- 29	新股 流通 受限	12.0 8	23.0 6	234	2,82 6.72	5,39 6.04	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	新股 流通 受限	10.6 4	10.6 4	421	4,47 9.44	4,47 9.44	-
3010	德迈	2021	2021	新股	5.29	14.4	303	1,60	4,37	-

07	仕	-06-04	-12-16	流通受限		4		2.87	5.32	
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
300919	中伟股份	2020-12-23	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	537	13,210.20	87,531.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。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。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立规范科学有效的内部风险管理体系结构。董事会是公司风险管理的最高决策机构，授权公司经营管理层建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的具体规章制度，组织实施各类风险的识别与评估工作；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，风险管理部负责拟定公司的风险管理政策、风险管理流程和具体制度，并具体实施，确保公司整体风险得到有效的识别、监控和管理，确保公司各项内部管理制度得到有效执行。基金管理业务合规负责人对董事会负责并报告工作，负责监督检查公募基金业务的合法合规性并对内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。

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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。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进行限制以控制相应的信用风险。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	237,000.00
AAA以下	5,889,574.41	7,282,247.26
未评级	-	-
合计	5,889,574.41	7,519,247.26

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

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，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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2021年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中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得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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未来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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	49,110,933.28	-	-	-	49,110,933.28
结算备付金	221,084.38	-	-	-	221,084.38
存出保	129,334.75	-	-	-	129,334.75

证金					
交易性金融资产	-	-	5,889,574.41	364,028,062.98	369,917,637.39
应收证券清算款	-	-	-	416,383.36	416,383.36
应收利息	-	-	-	19,281.05	19,281.05
应收申购款	-	-	-	2,170,513.95	2,170,513.95
资产总计	49,461,352.41	0.00	5,889,574.41	366,634,241.34	421,985,168.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	750,697.82	750,697.82
应付赎回款	-	-	-	1,929,131.45	1,929,131.45
应付管理人报酬	-	-	-	481,026.21	481,026.21
应付托管费	-	-	-	80,171.04	80,171.04
应付交易费用	-	-	-	224,656.90	224,656.90
应交税费	-	-	-	60.89	60.89
其他负债	-	-	-	90,063.08	90,063.08
负债总计	-	-	-	3,555,807.39	3,555,807.39
利率敏感度缺口	49,461,352.41	0.00	5,889,574.41	363,078,433.95	418,429,360.77
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	53,661,718.31	-	-	-	53,661,718.31
结算备付金	388,985.91	-	-	-	388,985.91
存出保	249,068.34	-	-	-	249,068.34

证金					
交易性金融资产	-	-	7,519,247.26	413,928,342.97	421,447,590.23
应收利息	-	-	-	20,920.64	20,920.64
应收申购款	-	-	-	912,956.54	912,956.54
资产总计	54,299,772.56	0.00	7,519,247.26	414,862,220.15	476,681,239.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,472,165.31	6,472,165.31
应付赎回款	-	-	-	9,143,914.14	9,143,914.14
应付管理人报酬	-	-	-	567,273.10	567,273.10
应付托管费	-	-	-	94,545.51	94,545.51
应付交易费用	-	-	-	341,873.97	341,873.97
应交税费	-	-	-	62.36	62.36
其他负债	-	-	-	167,524.71	167,524.71
负债总计	-	-	-	16,787,359.10	16,787,359.10
利率敏感度缺口	54,299,772.56	0.00	7,519,247.26	398,074,861.05	459,893,880.87

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为1.41%（2020年12月31日：1.64%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020年12月31日：同）。

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

其他价格风险是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单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，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。

本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例范围为45%-90%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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	364,028,062.98	87.00	413,928,342.97	90.01
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产	—	—	—	—

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	364,028,062.98	87.00	413,928,342.97	90.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证综指、中小板指、创业板指”以外的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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 上证综指、中小板指、创业板指均上升5%	19,018,832.53	24,363,356.20
	2. 上证综指、中小板指、创业板指均下降5%	-19,018,832.53	-24,363,356.20

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	364,028,062.98	86.27
	其中：股票	364,028,062.98	86.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,889,574.41	1.40
	其中：债券	5,889,574.41	1.40
	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	49,332,017.66	11.69
8	其他各项资产	2,735,513.11	0.65
9	合计	421,985,168.16	100.00

注：由于四舍五入的原因，金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	244,734,393.43	58.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	279,580.90	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	3,632,580.00	0.87
H	住宿和餐饮业	34,494,842.26	8.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,737,875.28	19.30
J	金融业	34,721.10	0.01
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	70,238.75	0.02
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	364,028,062.98	87.00

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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港股通股票。

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	603906	龙蟠科技	1,143,203	40,012,105.00	9.56
2	000063	中兴通讯	1,137,100	37,785,833.00	9.03
3	300207	欣旺达	945,100	30,772,456.00	7.35
4	600754	锦江酒店	425,614	23,621,840.26	5.65
5	002230	科大讯飞	230,550	15,580,569.00	3.72
6	002409	雅克科技	185,800	15,049,800.00	3.60
7	300408	三环集团	351,720	14,919,962.40	3.57
8	300751	迈为股份	32,680	14,859,596.00	3.55
9	002410	广联达	210,114	14,329,774.80	3.42
10	600132	重庆啤酒	70,273	13,910,540.35	3.32
11	002180	纳思达	399,054	12,849,538.80	3.07
12	600258	首旅酒店	455,700	10,873,002.00	2.60
13	300378	鼎捷软件	493,400	10,593,298.00	2.53
14	002541	鸿路钢构	156,650	9,140,527.50	2.18
15	600862	中航高科	294,000	9,049,320.00	2.16
16	688111	金山办公	22,236	8,778,772.80	2.10
17	002439	启明星辰	296,693	8,607,063.93	2.06
18	002212	天融信	414,334	8,191,383.18	1.96

19	600600	青岛啤酒	60,915	7,044,819.75	1.68
20	002724	海洋王	440,600	5,996,566.00	1.43
21	002643	万润股份	334,400	5,945,632.00	1.42
22	688208	道通科技	66,378	5,774,222.22	1.38
23	688516	奥特维	35,466	5,248,968.00	1.25
24	300451	创业慧康	584,230	5,164,593.20	1.23
25	300768	迪普科技	124,100	4,793,983.00	1.15
26	300482	万孚生物	73,940	4,783,178.60	1.14
27	603613	国联股份	45,500	4,548,635.00	1.09
28	300470	中密控股	98,945	3,823,234.80	0.91
29	603535	嘉诚国际	103,788	3,632,580.00	0.87
30	300558	贝达药业	31,257	3,383,257.68	0.81
31	688166	博瑞医药	42,556	1,779,266.36	0.43
32	688085	三友医疗	18,841	822,032.83	0.20
33	688161	威高骨科	2,728	289,304.40	0.07
34	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.06
35	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.04
36	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
37	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.03
38	688109	品茗股份	1,301	93,802.10	0.02
39	300919	中伟股份	537	87,531.00	0.02
40	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
41	300957	贝泰妮	299	75,336.04	0.02
42	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
43	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.02
44	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
45	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
46	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.01
47	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
48	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
49	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01

50	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
51	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
52	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
53	300981	中红医疗	348	31,455.72	0.01
54	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
55	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
56	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
57	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
58	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
59	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
60	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
61	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
62	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
63	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
64	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
65	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
66	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
67	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
68	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
69	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
70	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
71	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
72	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
73	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
74	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
75	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
76	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
77	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
78	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
79	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
80	300950	德固特	219	8,569.47	0.00

81	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
82	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
83	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
84	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
85	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
86	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
87	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
88	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
89	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
90	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
91	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
92	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
93	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
94	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
95	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
96	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
97	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
98	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
99	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
100	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
101	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
102	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
103	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
104	300922	天秦装备	87	3,030.21	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	600754	锦江酒店	26,831,681.20	5.83

2	002044	美年健康	18,574,084.02	4.04
3	300751	迈为股份	18,333,338.95	3.99
4	002230	科大讯飞	14,697,138.40	3.20
5	600258	首旅酒店	13,288,772.51	2.89
6	300207	欣旺达	12,295,722.00	2.67
7	000063	中兴通讯	12,224,510.18	2.66
8	300378	鼎捷软件	9,325,634.00	2.03
9	300601	康泰生物	8,928,733.36	1.94
10	300144	宋城演艺	8,923,117.20	1.94
11	002410	广联达	8,334,562.00	1.81
12	002409	雅克科技	7,953,715.00	1.73
13	002180	纳思达	7,448,339.00	1.62
14	300122	智飞生物	7,267,808.00	1.58
15	688208	道通科技	7,198,988.61	1.57
16	603906	龙蟠科技	6,905,693.60	1.50
17	300408	三环集团	6,851,619.30	1.49
18	300768	迪普科技	6,797,718.40	1.48
19	600862	中航高科	6,269,459.24	1.36
20	600132	重庆啤酒	5,644,486.00	1.23

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	603906	龙蟠科技	26,860,613.70	5.84
2	002511	中顺洁柔	25,801,672.26	5.61
3	300207	欣旺达	19,088,196.00	4.15
4	000568	泸州老窖	18,868,647.85	4.10
5	600809	DR山西汾	17,488,363.00	3.80
6	002044	美年健康	15,938,475.52	3.47

7	600438	通威股份	15,319,684.79	3.33
8	000858	五 粮 液	14,744,118.20	3.21
9	300122	智飞生物	13,361,383.00	2.91
10	000063	中兴通讯	13,229,087.44	2.88
11	600754	锦江酒店	13,224,231.66	2.88
12	600132	重庆啤酒	12,978,947.00	2.82
13	002541	鸿路钢构	11,568,432.00	2.52
14	603613	国联股份	9,941,982.80	2.16
15	300481	濮阳惠成	9,236,595.93	2.01
16	300144	宋城演艺	8,975,381.80	1.95
17	002180	纳思达	8,484,403.00	1.84
18	002601	龙蟠佰利	8,320,610.00	1.81
19	300601	康泰生物	7,928,100.88	1.72
20	603208	江山欧派	7,402,326.00	1.61

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	295,075,343.68
卖出股票收入（成交）总额	415,359,120.42

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”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)	5,889,574.41	1.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,889,574.41	1.41

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	123058	欣旺转债	26,338	4,032,426.81	0.96
2	128134	鸿路转债	13,754	1,857,147.60	0.44

本基金本报告期末只持有上述两只债券。

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 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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金对股指期货的投资以套期保值为主要目的，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行形势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相

应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。本基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

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

本基金对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 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	129,334.75
2	应收证券清算款	416,383.36
3	应收股利	—
4	应收利息	19,281.05
5	应收申购款	2,170,513.95
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,735,513.11

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	123058	欣旺转债	4,032,426.81	0.96
2	128134	鸿路转债	1,857,147.60	0.44

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600754	锦江酒店	14,859,399.36	3.55	非公开发行限售

§ 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
16,834	12,500.39	90,765,051.97	43.13%	119,666,512.14	56.87%

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	4,498,908.39	2.14%
------------------	--------------	-------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年03月23日)基金份额总额	323,361,874.08
本报告期期初基金份额总额	278,329,566.44
本报告期基金总申购份额	102,320,355.20
减：本报告期基金总赎回份额	170,218,357.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	210,431,564.11

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 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，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于财通资管价值发现混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，会议投票表决起止时间自2021年6月19日起至2021年7月17日17:00止（以表决票收件人收到表决票时间为准）。

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

本报告期内，无基金管理人的重大人事变动。2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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

本报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	144,239,609.54	20.87%	105,483.50	20.85%	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	31,162,414.94	4.51%	22,788.03	4.50%	-
东方财富证券	2	117,794,140.51	17.05%	86,140.35	17.02%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	204,835,143.13	29.64%	149,798.44	29.60%	-
天风	2	77,497,798.23	11.22%	56,670.26	11.20%	-

证券						
兴业 证券	2	115,487,712.80	16.71%	85,130.87	16.82%	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	135,490.10	0.48%	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	7,996,499.47	28.29%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	3,444,940.74	12.19%	-	-	-	-	-	-
天风证券	5,352,167.80	18.94%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	11,334,042.43	40.10%	-	-	-	-	-	-

注：a. 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金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，在业内有良好的声誉；
- 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，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；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。

b. 基金交易单元的选择程序如下：

- 1、本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2、基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

c. 本报告期内本基金无减少交易单元，新增东方证券、东方财富证券各两个交易单元。

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	财通资管价值发现混合型证券投资基金风险揭示书	证券时报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2021-01-06
2	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司新增定期定额投资业务和转换业务的公告	同上	2021-02-25
3	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在中国农业银行股份有限公司开通转换业务的公告	同上	2021-02-26
4	财通证券资产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	同上	2021-03-25
5	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在阳光人寿保险股份有限公司新增定期定额投资业务和转换业务的公告	同上	2021-04-23
6	财通证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购和定期定额投资最低金额限制的公告	同上	2021-05-17
7	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在蚂蚁	同上	2021-06-08

	(杭州)基金销售有限公司 新增定期定额投资业务和转 换业务的公告		
8	关于以通讯方式召开财通资 管价值发现混合型证券投资 基金基金份额持有人大会的 公告	同上	2021-06-17
9	关于以通讯方式召开财通资 管价值发现混合型证券投资 基金基金份额持有人大会的 第一次提示性公告	同上	2021-06-18
10	关于以通讯方式召开财通资 管价值发现混合型证券投资 基金基金份额持有人大会的 第二次提示性公告	同上	2021-06-19

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210415	61,842,035.52	-	36,842,035.52	25,000,000.00	11.88%
	2	20210325-20210630	37,642,187.39	20,491,157.87	-	58,133,345.26	27.63%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额 20%的情况。如该类投资者集中赎回,可能会对本基金造成流动性风险,从而影响基金的投资运作和收益水平。管理人将在基金运作中加强流动性管理,保持合适的流动性水平,对申购赎回进行合理的应对,防范流动性风险,保障持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、财通资管价值发现混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管价值发现混合型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管价值发现混合型证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司
二〇二一年八月三十日