

财通资管宸瑞一年持有期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20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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	19
§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	50
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§9 开放式基金份额变动	59
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	财通资管宸瑞一年持有期混合	
基金主代码	010413	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年01月20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	2,135,797,000.02份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通资管宸瑞一年持有期混合A	财通资管宸瑞一年持有期混合C
下属分级基金的交易代码	010413	010414
报告期末下属分级基金的份额总额	1,919,086,608.03份	216,710,391.99份

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×75%+中债综合指数收益率×25%
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
信息披露负责人	姓名	刘泉	秦一楠
	联系电话	021-20568203	010-66060069
	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20日（基金合同生效日）-2021年06月30日)	
	财通资管宸瑞一年持有期混合A	财通资管宸瑞一年持有期混合C
本期已实现收益	35,455,505.12	3,415,740.47
本期利润	184,629,488.36	20,035,040.43
加权平均基金份额本期利润	0.0965	0.0941
本期加权平均净值利润率	9.64%	9.41%
本期基金份额净值增长率	9.64%	9.35%
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	35,497,910.82	3,425,039.18
期末可供分配基金份额利润	0.0185	0.0158
期末基金资产净值	2,104,045,077.57	236,969,237.15
期末基金份额净值	1.0964	1.0935
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	9.64%	9.35%

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）。

4、本基金合同于2021年01月20日生效，截止报告期末本基金合同生效未满半年。

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

财通资管宸瑞一年持有期混合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	4.00%	0.81%	-1.52%	0.60%	5.52%	0.21%
过去三个月	12.00%	0.71%	2.77%	0.73%	9.23%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	9.64%	0.83%	-2.68%	0.97%	12.32%	-0.14%

财通资管宸瑞一年持有期混合C

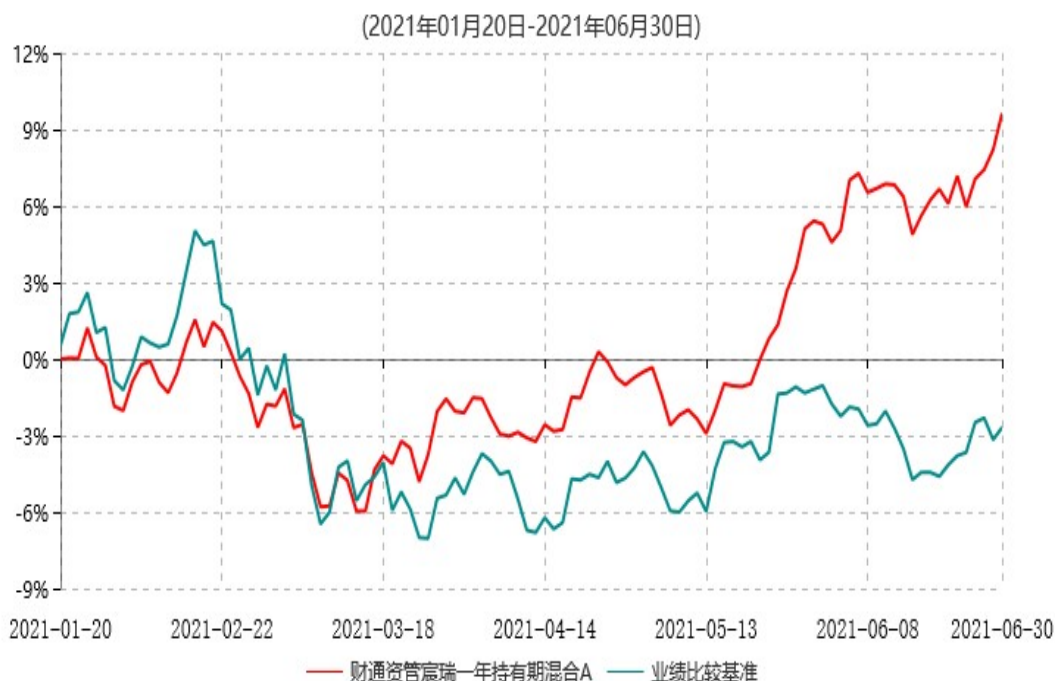
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.94%	0.81%	-1.52%	0.60%	5.46%	0.21%
过去三个月	11.84%	0.71%	2.77%	0.73%	9.07%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	9.35%	0.83%	-2.68%	0.97%	12.03%	-0.14%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×75%+中债综合指数收益率×25%

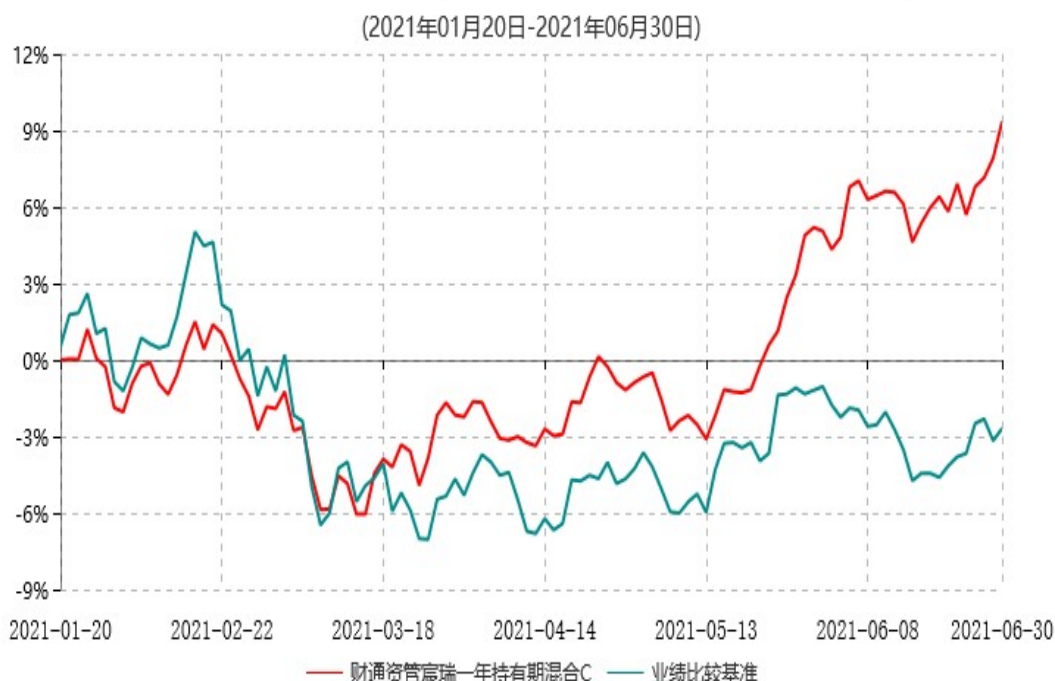
2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

财通资管宸瑞一年持有期混合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



财通资管宸瑞一年持有期混合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



注：1、本基金合同于 2021 年 1 月 20 日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。
2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月，报告期末本基金未建仓完毕。
3、自基金合同生效至报告期末，财通资管宸瑞一年持有期混合 A 基金份额净值增长率为 9.64%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%；财通资管宸瑞一年持有期混合 C 基金份额净值增长率为 9.35%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%。

§ 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、财通资管价值发现混合型证券投资基金、财通资管价值成	2021-01-20	-	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

	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。				业研究员、股票投资经理、股票投资部负责人、股票投资决策会委员；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、财通资管价值发现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。	2021-01-22	-	5	北京大学软件工程硕士。2016年1月起加入财通证券资产管理有限公司，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《财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管宸瑞一年持有期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，本基金处于建仓期，管理人维持中低仓位谨慎建仓，逐步积累安全垫，主要采用GARP策略精选估值性价比较高、业绩增速确定性较强的优质标的进行配置，重点配置的行业有计算机、通信、新能源、食品饮料、休闲服务等，行业配置适度均衡，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宸瑞一年持有期混合A基金份额净值为1.0964元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.64%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%；截至报告期末财通资管宸瑞一年持有期混合C基金份额净值为1.0935元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.35%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%。

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，经济已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20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的真实、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，未发现有关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：财通资管宸瑞一年持有期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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	237,340,844.80
结算备付金		604,753,655.82
存出保证金		427,503.09
交易性金融资产	6.4.7.2	1,514,868,608.31
其中：股票投资		1,514,868,608.31
基金投资		—
债券投资		—
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		3,512,549.23
应收利息	6.4.7.5	328,887.44
应收股利		—
应收申购款		507,315.05
递延所得税资产		—

其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,361,739,363.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30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		16,247,678.99
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,798,977.17
应付托管费		466,496.19
应付销售服务费		112,996.95
应付交易费用	6.4.7.7	1,000,757.24
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	98,142.48
负债合计		20,725,049.02
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	2,135,797,000.02
未分配利润	6.4.7.10	205,217,314.70
所有者权益合计		2,341,014,314.72
负债和所有者权益总计		2,361,739,363.74

注：1、报告截止日2021年6月30日，A类基金份额净值1.0964元，C类基金份额净值1.0935元；基金份额总额2,135,797,000.02份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额1,919,086,608.03份，C类基金份额总额216,710,391.99份。

2、本基金合同生效日为2021年01月20日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月20日（基金合同 生效日）至2021年06月30 日
一、收入		225,034,709.32
1. 利息收入		5,720,601.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,702,510.29
债券利息收入		243.91
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		17,847.48
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		53,520,824.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	50,846,793.74
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	3,901.89
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	2,670,128.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	165,793,283.20
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	-
减：二、费用		20,370,180.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,091,494.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,348,582.37

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	563,727.39
4. 交易费用	6.4.7.18	3,260,677.47
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	105,699.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		204,664,528.79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		204,664,528.79

注：本基金合同生效日为2021年01月20日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）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）	2,125,562,434.06	-	2,125,562,434.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	204,664,528.79	204,664,528.79
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）	10,234,565.96	552,785.91	10,787,351.87
其中：1. 基金申购款	10,234,565.96	552,785.91	10,787,351.87
2. 基金赎回款	-	-	-

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）	2,135,797,000.02	205,217,314.70	2,341,014,314.72

注：本基金合同生效日为2021年01月20日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

财通资管宸瑞一年持有期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[2020]2425号《关于准予财通资管宸瑞一年持有期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《财通资管宸瑞一年持有期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。根据《财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金对每份基金份额设置一年的最短持有期。对于每份基金份额，最短持有期起始日指基金合同生效日或该基金份额申购申请确认日；最短持有期到期日指该基金份额最短持有期起始日起一年后的年度对日。如无此年度对日或该对日为非工作日，则顺延至下一工作日。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,124,768,086.05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(2021)第0089号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年1月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,125,562,434.06份基金份额，其中认购资金利息折合794,348.01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《财通资管宸瑞一年持有期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

括主板、中小板、创业板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、股票期权、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60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 $\times$ 75%+中债综合指数收益率 $\times$ 25%。

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》、《财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在中国证监会、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20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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现

损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组

成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4) 本基金确定资产支持证券的公允价值时采用估值技术。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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	237,340,844.80
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	237,340,844.80

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		1,349,075,325.11	1,514,868,608.31	165,793,283.20
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	1,349,075,325.11	1,514,868,608.31	165,793,283.20

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	52,040.84
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	276,673.44
应收债券利息	-
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	173.16
合计	328,887.44

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	1,000,757.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,000,757.24

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	98,142.48
合计	98,142.48

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 财通资管宸瑞一年持有期混合A

金额单位：人民币元

项目 (财通资管宸瑞一年持有期混合A)	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,913,320,146.30	1,913,320,146.30
本期申购	5,766,461.73	5,766,461.73
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,919,086,608.03	1,919,086,608.03

6.4.7.9.2 财通资管宸瑞一年持有期混合C

金额单位：人民币元

项目 (财通资管宸瑞一年持有期混合C)	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	212,242,287.76	212,242,287.76
本期申购	4,468,104.23	4,468,104.23
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	216,710,391.99	216,710,391.99

注：申购转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 财通资管宸瑞一年持有期混合A

单位：人民币元

项目 (财通资管宸瑞一年持有期混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	35,455,505.12	149,173,983.24	184,629,488.36
本期基金份额交易产生的变动数	42,405.70	286,575.48	328,981.18
其中：基金申购款	42,405.70	286,575.48	328,981.18
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,497,910.82	149,460,558.72	184,958,469.54

6.4.7.10.2 财通资管宸瑞一年持有期混合C

单位：人民币元

项目 (财通资管宸瑞一年持有期混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	3,415,740.47	16,619,299.96	20,035,040.43
本期基金份额交易产生的变动数	9,298.71	214,506.02	223,804.73
其中：基金申购款	9,298.71	214,506.02	223,804.73
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,425,039.18	16,833,805.98	20,258,845.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
活期存款利息收入	1,597,630.80
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	4,102,445.72
其他	2,433.77
合计	5,702,510.29

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20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
卖出股票成交总额	865,153,104.03
减：卖出股票成本总额	814,306,310.29
买卖股票差价收入	50,846,793.74

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20日（基金合同生效日）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	3,901.89
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	3,901.89

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20日（基金合同生效日）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	2,186,145.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,182,000.00
减：应收利息总额	243.91
买卖债券差价收入	3,901.89

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20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,670,128.81
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	2,670,128.81

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20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	165,793,283.20
——股票投资	165,793,283.20
——债券投资	-
——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	165,793,283.20

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
交易所市场交易费用	3,260,677.47
银行间市场交易费用	—
合计	3,260,677.47

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
审计费用	46,821.24
信息披露费	46,821.24
证券出借违约金	—
汇划手续费	5,648.56
帐户维护费	6,000.00
开户费	400.00
其他费用	8.00
合计	105,699.04

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20日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	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	176,399,851.36	5.96%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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20日（基金合同生效日）至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比 例		额的比例
财通证券 股份有限 公司	76,079.67	3.60%	-	-

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20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,091,494.26
其中：支付销售机构的客户维护费	6,910,596.13

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20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,348,582.37

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管宸瑞一年持有期混 合A	财通资管宸瑞一年持有期混 合C	合计
财通证券 股份有限 公司	-	197,197.25	197,197.25
财通证券 资产管理 有限公司	-	13,499.27	13,499.27
中国农业 银行股份 有限公司	-	61,322.86	61,322.86
合计	-	272,019.38	272,019.38

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%的年费率计提，具体计算方法如下：每日C类基金份额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×0.60%÷当年天数。基金销售服务费每日计提，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

财通资管宸瑞一年持有期混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
基金合同生效日（2021年01月20日）持有的基金份额	19,999,000.00
报告期初持有的基金份额	—
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	—
报告期末持有的基金份额	19,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.94%

财通资管宸瑞一年持有期混合C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日
基金合同生效日（2021年01月20日）持有的基金份额	—
报告期初持有的基金份额	—
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	—
报告期末持有的基金份额	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—

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，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20日（基金合同生效日）至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	237,340,844.80	1,597,630.80

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	1,356,502	60,499,989.20	74,173,529.36	-
688161	威高骨科	2021-06-	2021-12-	新股流通	36.22	82.27	3,069	111,159.	252,486.	-

		23	30	受限				18	63	
3009 57	贝泰 妮	2021 -03- 18	2021 -09- 27	新股 流通 受限	47.3 3	251. 96	853	40,3 72.4 9	214, 921. 88	-
6883 29	艾隆 科技	2021 -03- 16	2021 -09- 29	新股 流通 受限	16.8 1	50.0 4	1,846	31,0 31.2 6	92,3 73.8 4	-
6884 99	利元 亨	2021 -06- 23	2021 -07- 01	新股 未上 市	38.8 5	38.8 5	2,149	83,4 88.6 5	83,4 88.6 5	-
3009 79	华利 集团	2021 -04- 15	2021 -10- 26	新股 流通 受限	33.2 2	87.5 0	925	30,7 28.5 0	80,9 37.5 0	-
6886 36	智明 达	2021 -03- 30	2021 -10- 08	新股 流通 受限	34.5 0	80.7 2	918	31,6 71.0 0	74,1 00.9 6	-
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2021 -07- 07	新股 未上 市	8.29	8.29	7,029	58,2 70.4 1	58,2 70.4 1	-
6882 39	航宇 科技	2021 -06- 25	2021 -07- 05	新股 未上 市	11.4 8	11.4 8	4,926	56,5 50.4 8	56,5 50.4 8	-
3009 81	中红 医疗	2021 -04- 19	2021 -10- 27	新股 流通 受限	48.5 9	90.3 9	601	29,2 02.5 9	54,3 24.3 9	-
6880 87	英科 再生	2021 -06- 30	2021 -07- 09	新股 未上 市	21.9 6	21.9 6	2,469	54,2 19.2 4	54,2 19.2 4	-
6882 60	昀冢 科技	2021 -03- 25	2021 -10- 08	新股 流通 受限	9.63	16.4 1	2,990	28,7 93.7 0	49,0 65.9 0	-
3009 73	立高 食品	2021 -04- 10	2021 -10- 10	新股 流通	28.2 8	115. 71	360	10,1 80.8	41,6 55.6	-

		08	15	受限				0	0	
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2021 -07- 06	新股 未上 市	10.6 4	10.6 4	3,789	40,3 14.9 6	40,3 14.9 6	-
3009 53	震裕 科技	2021 -03- 11	2021 -09- 22	新股 流通 受限	28.7 7	99.8 5	240	6,90 4.80	23,9 64.0 0	-
3010 09	可靠 股份	2021 -06- 08	2021 -12- 17	新股 流通 受限	12.5 4	27.8 9	801	10,0 44.5 4	22,3 39.8 9	-
3010 15	百洋 医药	2021 -06- 22	2021 -12- 30	新股 流通 受限	7.64	38.8 3	462	3,52 9.68	17,9 39.4 6	-
6882 26	威腾 电气	2021 -06- 28	2021 -07- 07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,2 89.0 6	17,2 89.0 6	-
3009 82	苏文 电能	2021 -04- 19	2021 -10- 27	新股 流通 受限	15.8 3	45.2 9	317	5,01 8.11	14,3 56.9 3	-
3009 68	格林 精密	2021 -04- 06	2021 -10- 15	新股 流通 受限	6.87	12.0 7	1,162	7,98 2.94	14,0 25.3 4	-
3006 14	百川 畅银	2021 -05- 18	2021 -11- 25	新股 流通 受限	9.19	40.3 8	329	3,02 3.51	13,2 85.0 2	-
3009 97	欢乐 家	2021 -05- 26	2021 -12- 02	新股 流通 受限	4.94	13.0 5	928	4,58 4.32	12,1 10.4 0	-
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- 07	2021 -07- 07	新股 未上	31.5 6	31.5 6	349	11,0 14.4	11,0 14.4	-

		28	06	市				4	4	
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-	2021-10-	新股流通	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

		15	26	受限						
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301007	德迈仕	2021-06-	2021-12-	新股流通	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-

		04	16	受限						
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	-

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。基金管理人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

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

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在满足最短持有期要求后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上市公司发行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该比例限制)。

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、结算备付金和存出保证金等。

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	237,340,844.80	-	-	-	237,340,844.80
结算备付金	948,466.24	-	-	603,805,189.58	604,753,655.82
存出保证金	427,503.09	-	-	-	427,503.09
交易性金融资产	-	-	-	1,514,868,608.31	1,514,868,608.31
应收证券清算款	-	-	-	3,512,549.23	3,512,549.23
应收利息	-	-	-	328,887.44	328,887.44
应收申购款	-	-	-	507,315.05	507,315.05
资产总计	238,716,814.13	0.00	0.00	2,123,022,549.61	2,361,739,363.74
负债					
应付证券清算	-	-	-	16,247,678.99	16,247,678.99

款					
应付管理人报酬	-	-	-	2,798,977.17	2,798,977.17
应付托管费	-	-	-	466,496.19	466,496.19
应付销售服务费	-	-	-	112,996.95	112,996.95
应付交易费用	-	-	-	1,000,757.24	1,000,757.24
其他负债	-	-	-	98,142.48	98,142.48
负债总计	-	-	-	20,725,049.02	20,725,049.02
利率敏感度缺口	238,716,814.13	0.00	0.00	2,102,297,500.59	2,341,014,314.72

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，本基金未持有债券资产，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60%-95%，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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,514,868,608.31	64.71
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—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	1,514,868,608.31	64.71

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
	1. 上证综指、中小板指、创业板指均上升5%	72,929,527.80
	2. 上证综指、中小板指、创业板指均下降5%	-72,929,527.80

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	1,514,868,608.31	64.14
	其中：股票	1,514,868,608.31	64.14
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	842,094,500.62	35.66
8	其他各项资产	4,776,254.81	0.20
9	合计	2,361,739,363.74	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	951,925,840.06	40.66
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	0.00
F	批发和零售业	257,526.54	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	144,798,177.36	6.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	417,787,060.97	17.85
J	金融业	34,721.10	0.00
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	21,451.02	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,514,868,608.31	64.71

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值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	000063	中兴通讯	6,437,292	213,911,213.16	9.14

2	603906	龙蟠科技	5,953,377	208,368,195.00	8.90
3	300207	欣旺达	3,508,400	114,233,504.00	4.88
4	600754	锦江酒店	2,026,702	112,341,419.36	4.80
5	300408	三环集团	2,268,131	96,214,117.02	4.11
6	300751	迈为股份	190,433	86,589,885.10	3.70
7	002230	科大讯飞	1,223,400	82,677,372.00	3.53
8	002439	启明星辰	2,707,178	78,535,233.78	3.35
9	002180	纳思达	2,180,386	70,208,429.20	3.00
10	300378	鼎捷软件	2,681,283	57,567,146.01	2.46
11	300451	创业慧康	5,662,631	50,057,658.04	2.14
12	002212	天融信	2,350,000	46,459,500.00	1.98
13	002410	广联达	633,447	43,201,085.40	1.85
14	300253	卫宁健康	2,231,700	36,309,759.00	1.55
15	002643	万润股份	2,037,708	36,230,448.24	1.55
16	600258	首旅酒店	1,360,300	32,456,758.00	1.39
17	600132	重庆啤酒	128,103	25,357,988.85	1.08
18	600600	青岛啤酒	210,747	24,372,890.55	1.04
19	002409	雅克科技	291,500	23,611,500.00	1.01
20	300768	迪普科技	594,331	22,959,006.53	0.98
21	600862	中航高科	740,100	22,780,278.00	0.97
22	688155	先惠技术	161,274	19,207,733.40	0.82
23	300482	万孚生物	71,930	4,653,151.70	0.20
24	688085	三友医疗	106,613	4,651,525.19	0.20
25	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.01
26	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
27	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
28	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
29	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.00
30	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
31	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
32	688636	智明达	918	74,100.96	0.00

33	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
34	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
35	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
36	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
37	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
38	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
39	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
40	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
41	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
42	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
43	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
44	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
45	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
46	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
47	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
48	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
49	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
50	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
51	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
52	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
53	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
54	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
55	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
56	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
57	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
58	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
59	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
60	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
61	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
62	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
63	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00

64	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
65	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
66	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
67	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
68	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
69	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
70	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
71	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
72	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
73	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
74	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
75	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000063	中兴通讯	256,774,847.15	10.97
2	603906	龙蟠科技	233,552,767.25	9.98
3	300408	三环集团	143,416,099.13	6.13
4	600754	锦江酒店	135,274,167.78	5.78
5	300207	欣旺达	119,620,816.43	5.11
6	002044	美年健康	112,614,171.22	4.81
7	300751	迈为股份	105,466,624.01	4.51
8	002180	纳思达	86,514,962.60	3.70
9	002439	启明星辰	80,090,984.19	3.42
10	002230	科大讯飞	74,590,671.64	3.19
11	300122	智飞生物	63,941,159.12	2.73
12	002511	中顺洁柔	62,446,273.45	2.67
13	300378	鼎捷软件	61,188,203.27	2.61

14	300451	创业慧康	50,319,810.82	2.15
15	002212	天融信	47,938,452.20	2.05
16	002410	广联达	45,549,052.95	1.95
17	300144	宋城演艺	42,727,652.00	1.83
18	600600	青岛啤酒	42,462,965.41	1.81
19	600132	重庆啤酒	42,462,863.40	1.81
20	002643	万润股份	34,402,826.04	1.47

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603906	龙蟠科技	128,652,354.15	5.50
2	002044	美年健康	92,617,187.47	3.96
3	002511	中顺洁柔	68,408,947.00	2.92
4	300122	智飞生物	67,040,648.86	2.86
5	600754	锦江酒店	51,774,754.00	2.21
6	300408	三环集团	50,709,903.00	2.17
7	300144	宋城演艺	41,658,787.00	1.78
8	300751	迈为股份	38,639,717.85	1.65
9	000063	中兴通讯	36,755,147.01	1.57
10	688139	海尔生物	34,141,738.89	1.46
11	300207	欣旺达	30,025,210.00	1.28
12	002938	鹏鼎控股	28,914,461.04	1.24
13	600132	重庆啤酒	27,125,712.00	1.16
14	002180	纳思达	25,436,257.50	1.09
15	600600	青岛啤酒	25,113,957.00	1.07
16	300481	濮阳惠成	21,861,640.40	0.93
17	002232	启明信息	20,352,643.69	0.87
18	600219	南山铝业	19,175,284.25	0.82

19	600570	恒生电子	17,438,651.10	0.74
20	300642	透景生命	16,333,042.00	0.70

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	2,163,381,635.40
卖出股票收入（成交）总额	865,153,104.03

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

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 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。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	427,503.09
2	应收证券清算款	3,512,549.23
3	应收股利	—
4	应收利息	328,887.44
5	应收申购款	507,315.05
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,776,254.81

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

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	74,173,529.36	3.17	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

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
财通资管宸瑞一年持有期混合A	19,976	96,069.61	28,189,006.56	1.47%	1,890,897,601.47	98.53%
财通资管宸瑞一年持有期混	17,237	12,572.40	—	—	216,710,391.99	100.00%

合C						
合计	37,213	57,393.84	28,189,006.56	1.32%	2,107,607,993.46	98.68%

注：分级基金机构/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	财通资管宸瑞一年持有期混合A	970,866.01	0.05%
	财通资管宸瑞一年持有期混合C	30,031.57	0.01%
	合计	1,000,897.58	0.05%

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	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	财通资管宸瑞一年持有期混合A	0~10
	财通资管宸瑞一年持有期混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	财通资管宸瑞一年持有期混合A	0
	财通资管宸瑞一年持有期混合C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管宸瑞一年持有	财通资管宸瑞一年持有
--	------------	------------

	期混合A	期混合C
基金合同生效日(2021年01月20日)基金份额总额	1, 913, 320, 146. 30	212, 242, 287. 76
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5, 766, 461. 73	4, 468, 104. 23
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1, 919, 086, 608. 03	216, 710, 391. 99

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

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，未涉及基金管理人、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

本报告期内，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	-	-	-	-	-
财通证券	2	176,399,851.36	5.96%	76,079.67	3.60%	-
长江证券	2	965,996,235.49	32.63%	706,434.18	33.45%	-
东方财富证券	2	61,297,599.50	2.07%	44,826.84	2.12%	-
东方证券	2	239,390,754.13	8.09%	175,061.64	8.29%	-
国泰君安证券	2	991,196,110.19	33.48%	724,852.44	34.32%	-
天风证券	2	233,948,822.61	7.90%	171,083.20	8.10%	-
兴业证券	2	292,358,823.49	9.88%	213,800.19	10.12%	-

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	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	2,186,145.80	100.00%	323,800,000.00	100.00%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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，新增长江证券、天风证券、兴业证券、国泰君安
证券、财通证券、东方证券、东方财富证券各两个交易单元，新增东兴证券一个交易单
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	财通资管宸瑞一年持有期混 合型证券投资基金基金份额 发售公告	证券时报、管理人网站（ww w.ctzg.com）和中国证监会 基金电子披露网站（http:/	2021-01-04

		/eid.csrc.gov.cn/fund)	
2	财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金风险揭示书	同上	2021-01-06
3	财通证券资产管理有限公司关于运用自有资金认购旗下基金相关事宜的公告	同上	2021-01-08
4	财通证券资产管理有限公司关于财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	同上	2021-01-21
5	财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2021-01-21
6	财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-01-22
7	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
8	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
9	财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购和定期定额投资业务公告	同上	2021-04-19

§ 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、财通资管宸瑞一年持有期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、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管宸瑞一年持有期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