

财通价值动量混合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月28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。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
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 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
§5 托管人报告 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
§6 审计报告 .....	16
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
§7 年度财务报表 .....	19
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	24
§8 投资组合报告 .....	56
8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57
8.3 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 .....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	66
8.6 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 .....	67
8.7 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 .....	67
8.8 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 .....	67
8.9 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 .....	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
8.12 投资组合报告附注 .....	68
§9 基金份额持有人信息 .....	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	70
9.3 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 .....	70
§10 开放式基金份额变动 .....	70
§11 重大事件揭示 .....	70
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
11.2 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 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4 基金投资策略的改变 .....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	80
12.1 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 .....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
§13 备查文件目录 .....	81
13.1 备查文件目录 .....	81
13.2 存放地点 .....	81
13.3 查阅方式 .....	81

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通价值动量混合型证券投资基金
基金简称	财通价值动量混合
场内简称	-
基金主代码	720001
交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2011年12月01日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	609,645,770.09份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以价值投资为基础，辅以对市场运行规律的研判，动态调整投资组合，在严格控制风险并充分保证流动性的前提下，力求获取超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金的资产配置策略为以评估不同投资品种的整体投资价值进行战略资产配置，以动量特征为依据进行战术资产配置；个股投资策略充分贯彻“价值投资为基础，动量策略为辅助”的投资理念，分别在行业配置和个股精选两个层面进行基本面情况、估值以及动量效应的研究，挖掘出具有估值优势和动量效应的个股并构建股票投资组合；通过综合运用久期管理策略、收益率曲线策略、类属配置策略、套利和时机选择策略等组合管理手段进行固定收益证券投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60% + 上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股

	票型基金产品，属于中高风险、中高预期收益的基金产品。
--	----------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武祜
	联系电话	021-20537888
	电子邮箱	service@ctfund.com
客户服务电话	400-820-9888	95588
传真	021-20537999	010-66105798
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	吴林惠	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	460,436,522.62	1,098,518,135.12	366,643,249.73
本期利润	395,552,256.57	1,101,390,940.29	509,859,490.62
加权平均基金份额本期利润	0.7666	1.3473	0.8839
本期加权平均净值利润率	17.30%	42.53%	42.78%
本期基金份额净值增长率	28.52%	51.29%	70.96%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	1,560,103,173.25	1,003,917,797.73	259,019,416.17
期末可供分配基金份额利润	2.5590	1.5971	0.2092
期末基金资产净值	2,895,873,859.98	2,323,171,367.11	3,024,658,332.40
期末基金份额净值	4.750	3.696	2.443
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	528.29%	388.88%	223.14%

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
过去三个月	-3.85%	1.43%	1.37%	0.48%	-5.22%	0.95%
过去六个月	19.02%	2.28%	-2.17%	0.61%	21.19%	1.67%

过去一年	28.52%	2.18%	-1.14%	0.70%	29.66%	1.48%
过去三年	232.40%	2.11%	43.33%	0.77%	189.07%	1.34%
过去五年	206.35%	1.82%	39.68%	0.72%	166.67%	1.10%
自基金合同生效起至今	528.29%	1.70%	85.30%	0.85%	442.99%	0.85%

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

(2)本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60% + 上证国债指数收益率×40%。

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

财通价值动量混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

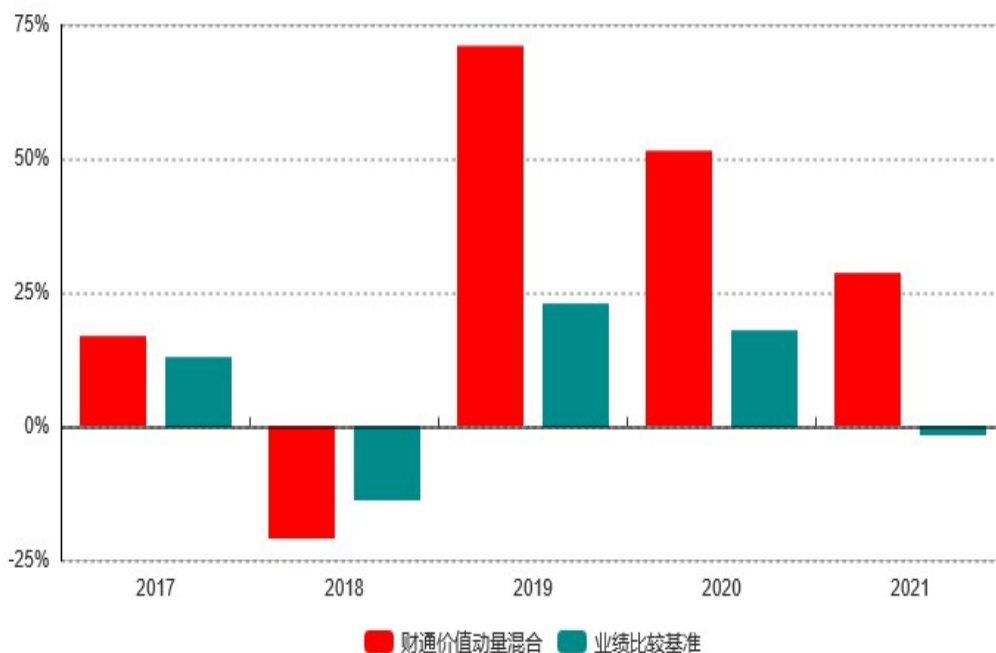


注：(1)本基金合同生效日为2011年12月1日；

(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截至报告期末和基金建仓期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金合同生效日为2011年12月1日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

截至2021年12月31日，本基金过去三年未进行过利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通基金管理有限公司成立于2011年6月，由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江瀚叶股份有限公司共同发起设立，财通证券股份有限公司为第一大股东，出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币，注册地上海，经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承“持有人利益至上”的核心价值观，致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面，公司坚持以客户利益为出发点设计产品，逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一，形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌，产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点，为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

截至2021年末，公司员工共计173人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在8年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金梓才	公司总经理助理、本基金的基金经理	2014-11-19	-	12年	上海交通大学工学硕士。历任华泰资产管理有限公司投资经理助理，信诚基金管理有限公司TMT行业高级研究员。现任财通基金管理有限公司总经理助理兼基金投资部总监兼基金经理。

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

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

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及公司管理制度，公司制定了《财通基金管理有限公司公平交易制度》，规范包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，以保证公司旗下管理的不同投资组合之间不存在利益输送并得到公平对待，以及保护投资者合法权益。

在投资决策环节：(1)内部建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境，不存在个别组合获得信息落后或不全面的情况；(2)建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序；(3)执行健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分；(4)建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息应相互隔离。

在交易执行环节：(1)集中交易部与投资、研究部门严格实行物理隔离，以充分保障集中交易部的独立性与保密性，同时建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；(2)投资交易系统支持公平交易功能，不同投资组合同向买卖同一证券的交易分配原则为“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”；(3)严格控制同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易；(4)所有投资对象的投资指令必须经由集中交易部负责人或其授权人审核分配至交易员执行，进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待，应保证不同投资组合在同一时点就同一投资对象下达的相同方向的投资指令分配给同一交易员完成；(5)对于交易所公开竞价交易，公司在投资交易系统设置强制公平交易模式，系统遇到该类两个或两个以上不同投资组合发出同向买卖指令情形时，会自动提示交易员进入公平交易模式；(6)对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配，申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。

在行为监控和分析报告环节：(1)风险管理部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则的要求；(2)风险管理部应根据市场公认的第三方信息，对投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查。相关投资组合经理应对交易价格异常情况进

行合理性解释；(3)风险管理部对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控和分析，相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

在交易价差分析和信息披露环节：(1)风险管理部负责交易价差分析；(2)风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异，对连续四个季度期间的不同时间窗内公司管理的不同投资组合进行同向交易的交易价差分析，形成公平交易报告并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存以备查；(3)在各投资组合的定期报告中，至少应披露以下事项：公司整体公平交易制度执行情况；对异常交易行为做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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

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

#### 4.4 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年四季度，我们对持仓组合做了大面积调整，我们从前三季度坚持的大周期赛道撤出，对化工等顺周期行业做了大面积减持，大幅增配了农林牧渔行业，小幅增配了航空、酒店、食品等行业。可以看到，这样的持仓调整动作较大，增配的几个行业代表了我们2022年较为看好的各个行业。

2021年全年，前三季度我们一直坚持在大周期赛道，总体上取得了较好的结果。但随着9月中旬开始，各细分领域价格斜率变陡，非正常因素导致价格快速上涨，股价提前见顶，我们从中也汲取了宝贵的投资经验和丰富。在2022年四季度，我们重配养殖产业链取得了较好的效果。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通价值动量混合基金份额净值为4.750元，本报告期内，基金份额净值增长率为28.52%，同期业绩比较基准收益率为-1.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，我们认为随着稳增长的措施出台，经济低点大概率已经过去，随着基建各个项目的发力，财政发力，我们认为经济底部已经探明。2022年大概率又是大宗商品价格回落的一年，很多中下游行业的成本压力有望缓解。同时，随着2022年内需的企稳以及疫情严管终将过去，大概率通胀会逐步回升。故我们综合判断，从需求端来看，可能出现较大概率超预期的行业将在服务业、必选消费各个领域，如果该行业还有价格的弹性或ROE的弹性，那将是我们的主攻方向。

经历三年权益市场牛市，货币政策两年宽松，客观来说，2022年的权益市场实现收益的难度增加。在复杂多变的市场环境下，我们仍然要在2022年力争为持有人获取较好的收益。我们也意识到，随着国内外利率上行的趋势增加，大部分行业的估值有下调风险。虽然我们对整体市场难言乐观，但我们对我们所重仓的板块有较大的信心。我们会从业绩趋势和估值趋势两方面出发，在以上提到的几个行业方向上做好选股。

我们将继续坚持以产业研究为基础，追求投资的可复制性、可跟踪性和前瞻性，在符合产业趋势的正确赛道上，投资较为优秀的公司，并保持密切跟踪，根据公司基本面的动态变化来做持仓的调整，在优质公司上做好大的波段，力争为投资者获取持续的超额回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。公司监察稽核部门在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对公司各项业务活动与相关制度等的合法性、合规性、合理性进行监督稽核、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全风险管理体系，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、基金投资部、专户投资部、固定收益部、研究部、风险管理部、监察稽核部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》。

根据中国证券投资基金业协会《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（中基协发〔2017〕6号），基金管理人与中证指数有限公司签订了《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，委托中证指数有限公司计算并提供流通受限股票流动性折扣。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金行政外包协议》，与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》，与申万宏源证券有限公司于2019年9月签订了《运营服务合同》、于2020年5月签订了《基金运营服务合同》。截至报告期末，基金管理人对旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%；

本报告期内本基金未进行过利润分配。

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

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本托管人依法对财通基金管理有限公司编制和披露的本基金2021年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60951782_B02 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	财通价值动量混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了财通价值动量混合型证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财通价值动量混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了财通价值动量混合型证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于财通价值动量混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用



<p>其他信息</p>	<p>财通价值动量混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估财通价值动量混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督财通价值动量混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执</p>

	<p>行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对财通价值动量混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致财通价值动量混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	朱宝钦、骆文慧
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
审计报告日期	2022-03-25

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：财通价值动量混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	622,829,196.62	272,450,742.10
结算备付金		9,044,813.46	6,377,716.73
存出保证金		1,399,680.46	814,229.16
交易性金融资产	7.4.7.2	2,343,822,341.66	2,008,694,068.42
其中：股票投资		2,155,375,271.88	1,863,521,129.87
基金投资		-	-
债券投资		188,447,069.78	145,172,938.55
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	78,775,153.86
应收利息	7.4.7.5	179,605.26	126,915.94
应收股利		-	-
应收申购款		6,201,655.47	6,121,257.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,983,477,292.93	2,373,360,083.75
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		65,816,789.63	19,957,444.68
应付赎回款		12,332,217.44	23,015,477.57
应付管理人报酬		3,524,841.38	2,922,224.02
应付托管费		587,473.58	487,037.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,296,557.20	2,726,834.06
应交税费		982.13	2,307.91
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,044,571.59	1,077,391.04
负债合计		87,603,432.95	50,188,716.64
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	609,645,770.09	628,578,735.29
未分配利润	7.4.7.10	2,286,228,089.89	1,694,592,631.82
所有者权益合计		2,895,873,859.98	2,323,171,367.11
负债和所有者权益总计		2,983,477,292.93	2,373,360,083.75

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

(2)报告截止日2021年12月31日，基金份额净值4.750元，基金份额总额609,645,770.09份。

## 7.2 利润表

会计主体：财通价值动量混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日

一、收入		461,002,676.14	1,168,330,766.83
1.利息收入		1,883,787.15	2,652,020.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	953,984.15	1,720,795.19
债券利息收入		929,803.00	914,435.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	16,790.27
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		517,869,476.68	1,153,823,817.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	532,609,388.23	1,047,830,890.25
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-34,799,700.84	91,330,512.47
资产支持证券投资	7.4.7.14.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	20,059,789.29	14,662,414.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-64,884,266.05	2,872,805.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	6,133,678.36	8,982,124.07
<b>减：二、费用</b>		65,450,419.57	66,939,826.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	34,314,203.00	38,865,610.18
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,719,033.75	6,477,601.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	25,157,835.48	21,338,068.60

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3,347.34	2,546.01
7. 其他费用	7.4.7.21	256,000.00	256,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		395,552,256.57	1,101,390,940.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		395,552,256.57	1,101,390,940.29

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通价值动量混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	628,578,735.29	1,694,592,631.82	2,323,171,367.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	395,552,256.57	395,552,256.57
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）	-18,932,965.20	196,083,201.50	177,150,236.30
其中：1.基金申购款	974,580,543.16	3,793,368,236.05	4,767,948,779.21
2.基金赎回款	-993,513,508.36	-3,597,285,034.55	-4,590,798,542.91
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）	609,645,770.09	2,286,228,089.89	2,895,873,859.98
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,238,278,396.74	1,786,379,935.66	3,024,658,332.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,101,390,940.29	1,101,390,940.29
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）	-609,699,661.45	-1,193,178,244.13	-1,802,877,905.58
其中：1.基金申购款	1,484,049,613.91	3,106,301,724.09	4,590,351,338.00
2.基金赎回款	-2,093,749,275.36	-4,299,479,968.22	-6,393,229,243.58
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）	628,578,735.29	1,694,592,631.82	2,323,171,367.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

汪海

刘为臻

刘为臻

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

财通价值动量混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1476号文《关于核准财通价值动量混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2011年12月1日正式生效，首次设立募集规模为1,058,572,878.12份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构未来允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金是混合型证券投资基金，股票资产（含存托凭证）占基金资产的30%-80%，其中投资于价值公司股票池内的个股不少于股票资产的80%；债券、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的0%-65%，其中权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。



### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

(2)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；

(3)不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(4)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(5)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11)其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认；

(2)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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 1. 印花税

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

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

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

#### 2. 增值税

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

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

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

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

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

### 3.城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4.企业所得税

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	622,829,196.62	272,450,742.10
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	622,829,196.62	272,450,742.10

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,052,913,423.73	2,155,375,271.88	102,461,848.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	179,137,927.48	188,447,069.78	9,309,142.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	179,137,927.48	188,447,069.78	9,309,142.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,232,051,351.21	2,343,822,341.66	111,770,990.45
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,690,655,947.30	1,863,521,129.87	172,865,182.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	141,382,864.62	145,172,938.55	3,790,073.93
	银行间市场	-	-	-
	合计	141,382,864.62	145,172,938.55	3,790,073.93
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,832,038,811.92	2,008,694,068.42	176,655,256.50

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产或负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本年度末及上年度末未持有买入返售金融资产。



#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	46,867.20	15,507.97
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	4,070.10	2,869.90
应收债券利息	128,038.16	108,171.67
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	629.80	366.40
合计	179,605.26	126,915.94

注：其他为结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,296,557.20	2,726,034.06
银行间市场应付交易费用	-	800.00
合计	4,296,557.20	2,726,834.06

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	44,571.59	77,391.04
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	500,000.00	500,000.00
合计	1,044,571.59	1,077,391.04

#### 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	628,578,735.29	628,578,735.29
本期申购	974,580,543.16	974,580,543.16
本期赎回（以“-”号填列）	-993,513,508.36	-993,513,508.36
本期末	609,645,770.09	609,645,770.09

注：本期申购含红利再投、转换入份额，本期赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,003,917,797.73	690,674,834.09	1,694,592,631.82
本期利润	460,436,522.62	-64,884,266.05	395,552,256.57
本期基金份额交易产生的变动数	95,748,852.90	100,334,348.60	196,083,201.50
其中：基金申购款	2,488,734,353.82	1,304,633,882.23	3,793,368,236.05
基金赎回款	-2,392,985,500.92	-1,204,299,533.63	-3,597,285,034.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,560,103,173.25	726,124,916.64	2,286,228,089.89

#### 7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	802,993.23	1,579,942.35
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	105,640.95	94,972.78
其他	45,349.97	45,880.06
合计	953,984.15	1,720,795.19

注：本基金本期末其他利息收入包括结算保证金利息收入和应收申购款利息收入，分别为15356.15元和29993.82元。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	9,247,122,156.38	8,442,692,057.19
减：卖出股票成本总额	8,714,512,768.15	7,394,861,166.94
买卖股票差价收入	532,609,388.23	1,047,830,890.25

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付)	-34,799,700.84	91,330,512.47

差价收入		
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	-34,799,700.84	91,330,512.47

#### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,046,327,415.42	841,284,550.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,079,824,259.71	748,550,795.65
减：应收利息总额	1,302,856.55	1,403,242.26
买卖债券差价收入	-34,799,700.84	91,330,512.47

#### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资资产支持证券，资产支持证券收益为零。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

**7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	20,059,789.29	14,662,414.39
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	20,059,789.29	14,662,414.39

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1.交易性金融资产	-64,884,266.05	2,872,805.17
——股票投资	-70,403,334.42	17,566,316.23

——债券投资	5,519,068.37	-14,693,511.06
——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	-64,884,266.05	2,872,805.17

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	6,101,394.16	8,976,032.75
转换费收入	32,284.20	6,091.32
合计	6,133,678.36	8,982,124.07

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	25,157,835.48	21,337,268.60
银行间市场交易费用	-	800.00
合计	25,157,835.48	21,338,068.60

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
帐户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	256,000.00	256,000.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至2021年12月31日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
财通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
财通证券股份有限公司(“财通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
杭州市实业投资集团有限公司	基金管理人的股东
浙江瀚叶股份有限公司	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海财通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年01月01日至2020年12月31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	1,087,984,117.84	5.94%	56,493,693.88	0.38%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券	24,558,143.41	1.14%	-	-

注：本基金上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 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12月31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	1,004,136.52	7.09%	112,232.98	2.61%
关联方名	上年度可比期间			



称	2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	51,482.34	0.45%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	34,314,203.00	38,865,610.18
其中：支付销售机构的客户维护费	7,871,238.74	12,875,899.83

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数；

(3)客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,719,033.75	6,477,601.75

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

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

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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

**7.4.10.4 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**

**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**  
无。

**7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

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

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.5.2 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。

**7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	622,829,196.62	802,993.23	272,450,742.10	1,579,942.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年12月31日
-------------------------------

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 张/股)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 张/股)	总金额
财通证券	605255	天普股份	网下申购	530	6,709.80
财通证券	002863	今飞凯达	非公开发行	777,604	4,999,993.72

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

#### 7.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	估值 单价	(单 位:股)	成本 总额	估值 总额	
3006 23	捷捷 微电	2020- 01-10	2022- 01-10	非公开 发行限 售	21.18	31.20	82,625	1,74 9,99 7.50	2,57 7,90 0.00	-
3006 23	捷捷 微电	2020- 05-26	2022- 01-10	非公开 发行限 售-送 股	-	31.20	49,575	-	1,54 6,74 0.00	-
3006 23	捷捷 微电	2021- 04-29	2022- 01-10	非公开 发行限 售-送 股	-	31.20	66,100	-	2,06 2,32 0.00	-
6881 10	东芯 股份	2021- 12-03	2022- 06-10	新股限 售	30.18	40.37	14,044	423,8 47.92	566,9 56.28	-
6883 85	复旦 微电	2021- 07-27	2022- 02-07	新股限 售	6.23	48.58	8,986	55,98 2.78	436,5 39.88	-
6887 07	振华 新材	2021- 09-06	2022- 03-14	新股限 售	11.75	47.16	8,130	95,52 7.50	383,4 10.80	-
6882 62	国芯 科技	2021- 12-28	2022- 01-06	认购新 发证券	41.98	41.98	7,129	299,2 75.42	299,2 75.42	-
3011 36	招标 股份	2021- 12-31	2022- 01-11	认购新 发证券	10.52	10.52	7,172	75,44 9.44	75,44 9.44	-
6880 71	华依 科技	2021- 07-21	2022- 02-07	新股限 售	13.73	62.31	1,101	15,11 6.73	68,60 3.31	-
3010 87	可孚 医疗	2021- 10-15	2022- 04-25	新股限 售	93.09	75.34	848	78,94 0.32	63,88 8.32	-
3010 50	雷电 微力	2021- 08-17	2022- 02-24	新股限 售	60.64	234.7 4	233	14,12 9.12	54,69 4.42	-
6882 26	威腾 电气	2021- 06-28	2022- 01-07	新股限 售	6.42	15.76	2,693	17,28 9.06	42,44 1.68	-
3010 29	怡合 达	2021- 07-14	2022- 01-24	新股限 售	14.14	89.87	462	6,53 2.68	41,51 9.94	-

301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股限售	22.04	56.28	644	14,19 3.76	36,24 4.32	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股限售	10.45	11.22	2,764	28,88 3.80	31,01 2.08	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股限售	6.96	12.51	2,064	14,36 5.44	25,82 0.64	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股限售	3.55	18.24	1,386	4,92 0.30	25,28 0.64	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	新股限售	69.89	88.72	280	19,56 9.20	24,84 1.60	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股限售	66.18	56.62	435	28,78 8.30	24,62 9.70	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	5.17	44.21	539	2,78 6.63	23,82 9.19	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股限售	58.08	49.85	409	23,75 4.72	20,38 8.65	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股限售	8.29	26.06	782	6,48 2.78	20,37 8.92	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股限售	15.48	21.53	915	14,16 4.20	19,69 9.95	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股限售	4.17	30.94	587	2,44 7.79	18,16 1.78	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股限售	33.16	24.67	704	23,34 4.64	17,36 7.68	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新股限售	57.27	53.71	280	16,03 5.60	15,03 8.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股限售	43.99	50.77	295	12,97 7.05	14,97 7.15	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股限售	19.11	67.93	220	4,20 4.20	14,94 4.60	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股限售	10.48	36.68	379	3,97 1.92	13,90 1.72	-
3010	漱玉	2021-	2022-	新股限售	8.86	23.80	555	4,91	13,20	-

17	平民	06-23	01-05	售				7.30	9.00	
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股限售	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	新股限售	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	新股限售	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股限售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新股限售	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股限售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股限售	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股限售	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股限售	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	认购新发证券	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股限售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
3010	邵阳	2021-	2022-	新股限售	11.92	24.82	140	1,66	3,47	-

79	液压	10-11	04-19	售				8.80	4.80	
----	----	-------	-------	---	--	--	--	------	------	--

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

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，



结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现

能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	622,829,196.62	-	-	-	-	-	622,829,196.62
结算备付金	9,044,813.46	-	-	-	-	-	9,044,813.46
存出保证金	1,399,680.46	-	-	-	-	-	1,399,680.46

交易性金融资产	-	-	-	-	188,447,06 9.78	2,155,375,27 1.88	2,343,822,34 1.66
应收利息	-	-	-	-	-	179,605.26	179,605.26
应收申购款	4,771.37	-	-	-	-	6,196,884.10	6,201,655.47
资产总计	633,278,46 1.91	-	-	-	188,447,06 9.78	2,161,751,76 1.24	2,983,477,29 2.93
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	65,816,789.6 3	65,816,789.6 3
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,332,217.4 4	12,332,217.4 4
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,524,841.38	3,524,841.38
应付托管费	-	-	-	-	-	587,473.58	587,473.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,296,557.20	4,296,557.20
应交税费	-	-	-	-	-	982.13	982.13
其他负债	-	-	-	-	-	1,044,571.59	1,044,571.59
负债总计	-	-	-	-	-	87,603,432.9 5	87,603,432.9 5
利率敏感度缺口	633,278,46 1.91	-	-	-	188,447,06 9.78	2,074,148,32 8.29	2,895,873,85 9.98
上年	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

度末 2020 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	272,450,742.10	-	-	-	-	-	272,450,742.10
结算备付金	6,377,716.73	-	-	-	-	-	6,377,716.73
存出保证金	814,229.16	-	-	-	-	-	814,229.16
交易性金融资产	-	-	-	145,172,938.55	-	1,863,521,129.87	2,008,694,068.42
应收证券清算款	-	-	-	-	-	78,775,153.86	78,775,153.86
应收利息	-	-	-	-	-	126,915.94	126,915.94
应收申购款	-	-	-	-	-	6,121,257.54	6,121,257.54
资产总计	279,642,687.99	-	-	145,172,938.55	-	1,948,544,457.21	2,373,360,083.75
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	19,957,444.68	19,957,444.68
应付赎回款	-	-	-	-	-	23,015,477.57	23,015,477.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,922,224.02	2,922,224.02

应付托管费	-	-	-	-	-	487,037.36	487,037.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,726,834.06	2,726,834.06
应交税费	-	-	-	-	-	2,307.91	2,307.91
其他负债	-	-	-	-	-	1,077,391.04	1,077,391.04
负债总计	-	-	-	-	-	50,188,716.64	50,188,716.64
利率敏感度缺口	279,642,687.99	-	-	145,172,938.55	-	1,898,355,740.57	2,323,171,367.11

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有交易性固定收益类投资（不含可转债及可交换债券）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，股票资产（含存托凭证）占基金资产的30%-80%，其中投资于价值公司股票池内的个股不少于股票资产的80%；债券、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的0%-65%，其中权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	2,155,375,271.88	74.43	1,863,521,129.87	80.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	188,447,069.78	6.51	145,172,938.55	6.25
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,343,822,341.66	80.94	2,008,694,068.42	86.46

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准增加1%	37,327,896.38	44,501,294.91
	业绩比较基准减少1%	-37,327,896.38	-44,501,294.91

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### 1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 2)以公允价值计量的金融工具

##### (1)各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币2,334,999,045.45元，属于第二层次的余额为人民币380,229.35元，属于第三层次的余额为人民币8,443,066.86元（于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币1,732,449,024.96元，属于第二层次的余额为人民币207,119.06元，属于第三层次的余额为人民币276,037,924.40元）。

##### (2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

单位：人民币元

	交易性金融资产
上年度末	276,037,924.40
转入第三层次	-
转出第三层次	176,472,491.44
当期计入损益的利得或损失总额	-16,315,145.96
购买	2,791,463.29
出售	77,598,683.43
本期末	8,443,066.86
本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动	5,651,603.57

2、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

3、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	2,155,375,271.88	72.24
	其中：股票	2,155,375,271.88	72.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	188,447,069.78	6.32
	其中：债券	188,447,069.78	6.32
	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	631,874,010.08	21.18



8	其他各项资产	7,780,941.19	0.26
9	合计	2,983,477,292.93	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	609,800,736.18	21.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	985,251,021.12	34.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	62,328.68	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	256,111,608.03	8.84
H	住宿和餐饮业	207,821,790.15	7.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,145,008.63	3.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	110,873.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	15,811.84	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	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,155,375,271.88	74.43

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

## 8.3 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	002714	牧原股份	3,506,182	187,089,871.52	6.46
2	300498	温氏股份	9,475,379	182,495,799.54	6.30
3	002100	天康生物	15,852,153	169,618,037.10	5.86
4	002567	唐人神	22,488,735	167,990,850.45	5.80
5	601111	中国国航	18,274,314	166,844,486.82	5.76
6	002124	天邦股份	24,707,448	159,115,965.12	5.49
7	603363	傲农生物	12,408,618	157,589,448.60	5.44
8	300604	长川科技	2,397,430	137,852,225.00	4.76
9	600754	锦江酒店	2,056,800	120,528,480.00	4.16
10	002557	洽洽食品	1,913,889	117,436,229.04	4.06
11	002507	涪陵榨菜	2,619,075	99,001,035.00	3.42
12	688508	芯朋微	825,011	95,585,774.46	3.30
13	002840	华统股份	5,366,880	92,739,686.40	3.20
14	600029	南方航空	13,108,241	89,267,121.21	3.08
15	600258	首旅酒店	3,340,555	87,288,702.15	3.01
16	603477	巨星农牧	5,232,200	81,099,100.00	2.80
17	002805	丰元股份	1,096,915	34,607,668.25	1.20
18	300623	捷捷微电	198,300	6,186,960.00	0.21
19	688110	东芯股份	14,044	566,956.28	0.02
20	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.02
21	688707	振华新材	8,130	383,410.80	0.01
22	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
23	688206	概伦电子	6,000	220,140.00	0.01
24	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
25	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.00
26	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
27	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
28	688226	威腾电气	2,693	42,441.68	0.00

29	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
30	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
31	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
32	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
33	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
34	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
35	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
36	301189	C奥尼	435	24,629.70	0.00
37	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
38	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
39	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
40	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
41	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
42	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
43	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
44	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
45	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
46	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
47	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
48	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
49	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
50	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
51	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
52	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
53	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
54	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
55	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
56	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
57	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
58	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
59	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00

60	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
61	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
62	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
63	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
64	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.00
65	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
66	300975	商络电子	492	8,575.56	0.00
67	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
68	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
69	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
70	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
71	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
72	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
73	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
74	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
75	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
76	603216	梦天家居	272	6,878.88	0.00
77	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
78	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
79	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
80	301004	嘉益股份	312	6,389.76	0.00
81	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
82	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
83	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
84	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
85	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
86	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
87	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
88	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
89	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
90	301059	金三江	259	4,998.70	0.00

91	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
92	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
93	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
94	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
95	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
96	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	000933	神火股份	213,407,042.49	9.19
2	002170	芭田股份	202,615,134.21	8.72
3	002714	牧原股份	189,662,626.45	8.16
4	603938	三孚股份	182,983,956.00	7.88
5	000683	远兴能源	181,465,250.07	7.81
6	601012	隆基股份	180,439,197.93	7.77
7	603806	福斯特	179,053,797.65	7.71
8	002124	天邦股份	164,522,477.40	7.08
9	600596	新安股份	156,368,053.05	6.73
10	300498	温氏股份	156,004,995.49	6.72
11	601111	中国国航	153,742,496.18	6.62
12	002567	唐人神	153,025,842.42	6.59
13	002100	天康生物	149,427,960.58	6.43
14	600426	华鲁恒升	145,587,560.02	6.27
15	603363	傲农生物	145,334,333.10	6.26
16	000731	四川美丰	140,893,103.37	6.06
17	000301	东方盛虹	139,935,406.62	6.02
18	300604	长川科技	138,605,381.70	5.97
19	601636	旗滨集团	138,064,298.41	5.94

20	000703	恒逸石化	137,615,870.67	5.92
21	300505	川金诺	134,346,598.15	5.78
22	688508	芯朋微	133,395,950.79	5.74
23	002466	天齐锂业	133,387,533.20	5.74
24	601888	中国中免	133,293,062.59	5.74
25	002064	华峰化学	130,634,658.12	5.62
26	002371	北方华创	126,732,842.19	5.46
27	000912	泸天化	124,204,888.09	5.35
28	002557	洽洽食品	124,164,471.24	5.34
29	002895	川恒股份	121,485,277.40	5.23
30	300769	德方纳米	121,445,370.30	5.23
31	002805	丰元股份	117,697,213.00	5.07
32	600754	锦江酒店	117,355,029.65	5.05
33	600328	中盐化工	113,611,804.35	4.89
34	600019	宝钢股份	110,016,846.30	4.74
35	600219	南山铝业	106,316,514.51	4.58
36	601865	福莱特	104,717,937.66	4.51
37	000422	湖北宜化	104,102,832.73	4.48
38	300750	宁德时代	102,271,386.73	4.40
39	600438	通威股份	99,742,868.12	4.29
40	002507	涪陵榨菜	99,645,843.78	4.29
41	688680	海优新材	99,400,737.47	4.28
42	601678	滨化股份	99,124,652.81	4.27
43	000932	华菱钢铁	98,616,948.46	4.24
44	600031	三一重工	98,388,268.00	4.24
45	600782	新钢股份	98,009,202.47	4.22
46	603906	龙蟠科技	97,967,405.32	4.22
47	600699	均胜电子	97,630,114.44	4.20
48	002092	中泰化学	97,356,564.58	4.19
49	600519	贵州茅台	97,232,923.00	4.19
50	600096	云天化	95,550,673.00	4.11

51	600988	赤峰黄金	90,040,653.37	3.88
52	002312	川发龙蟒	88,635,794.50	3.82
53	601600	中国铝业	87,420,721.54	3.76
54	600282	南钢股份	86,885,228.48	3.74
55	002318	久立特材	86,329,999.02	3.72
56	600258	首旅酒店	86,169,902.37	3.71
57	603260	合盛硅业	85,453,612.48	3.68
58	002840	华统股份	84,547,544.33	3.64
59	000959	首钢股份	84,451,975.88	3.64
60	600029	南方航空	83,232,257.50	3.58
61	002192	融捷股份	82,440,428.81	3.55
62	002532	天山铝业	81,853,014.70	3.52
63	601918	新集能源	80,172,995.80	3.45
64	603477	巨星农牧	78,911,748.24	3.40
65	601168	西部矿业	77,412,199.50	3.33
66	300014	亿纬锂能	74,989,220.56	3.23
67	300568	星源材质	73,300,348.93	3.16
68	600641	万业企业	73,065,520.06	3.15
69	603077	和邦生物	72,924,334.40	3.14
70	600409	三友化工	72,099,587.52	3.10
71	688303	大全能源	70,283,923.93	3.03
72	300384	三联虹普	65,617,718.02	2.82
73	002541	鸿路钢构	60,387,437.24	2.60
74	600111	北方稀土	58,393,986.13	2.51
75	600188	兖矿能源	55,766,561.88	2.40
76	601100	恒立液压	55,191,688.32	2.38
77	601001	晋控煤业	54,570,928.72	2.35
78	300648	星云股份	48,295,319.26	2.08
79	600985	淮北矿业	46,843,071.12	2.02
80	601699	潞安环能	46,711,661.05	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	000683	远兴能源	327,118,958.21	14.08
2	000301	东方盛虹	268,165,712.41	11.54
3	000422	湖北宜化	249,238,806.57	10.73
4	601888	中国中免	226,233,365.40	9.74
5	002170	芭田股份	224,800,879.96	9.68
6	600328	中盐化工	212,828,752.37	9.16
7	000933	神火股份	211,837,578.47	9.12
8	600426	华鲁恒升	208,130,475.28	8.96
9	601012	隆基股份	168,481,798.08	7.25
10	603806	福斯特	164,433,066.92	7.08
11	002092	中泰化学	158,244,275.97	6.81
12	002493	荣盛石化	149,833,214.24	6.45
13	600409	三友化工	149,713,978.02	6.44
14	603456	九洲药业	148,102,414.25	6.38
15	002064	华峰化学	147,413,356.11	6.35
16	002895	川恒股份	143,130,653.60	6.16
17	600309	万华化学	142,008,256.41	6.11
18	600096	云天化	139,810,182.00	6.02
19	300502	新易盛	137,234,740.52	5.91
20	002466	天齐锂业	137,163,216.25	5.90
21	600346	恒力石化	131,170,547.11	5.65
22	300505	川金诺	124,217,289.61	5.35
23	600219	南山铝业	123,718,201.73	5.33
24	603938	三孚股份	122,988,256.80	5.29
25	601636	旗滨集团	119,115,747.55	5.13
26	300394	天孚通信	118,441,656.44	5.10



27	002371	北方华创	116,274,889.19	5.01
28	688680	海优新材	116,271,189.76	5.00
29	300363	博腾股份	114,336,460.68	4.92
30	002192	融捷股份	112,959,669.60	4.86
31	600596	新安股份	111,110,867.09	4.78
32	603906	龙蟠科技	110,102,556.42	4.74
33	300769	德方纳米	108,422,024.80	4.67
34	300408	三环集团	107,683,513.93	4.64
35	600438	通威股份	107,028,600.90	4.61
36	002805	丰元股份	104,393,702.00	4.49
37	600019	宝钢股份	102,595,523.19	4.42
38	000731	四川美丰	101,137,321.40	4.35
39	000932	华菱钢铁	98,091,834.87	4.22
40	600031	三一重工	98,049,506.00	4.22
41	000703	恒逸石化	97,391,179.40	4.19
42	300750	宁德时代	94,165,731.66	4.05
43	601865	福莱特	92,896,996.30	4.00
44	600519	贵州茅台	91,956,806.00	3.96
45	600782	新钢股份	91,581,172.00	3.94
46	601600	中国铝业	89,809,281.94	3.87
47	603993	洛阳钼业	88,300,764.50	3.80
48	000912	泸天化	86,338,215.08	3.72
49	603520	司太立	85,439,936.74	3.68
50	601899	紫金矿业	84,977,778.00	3.66
51	600641	万业企业	84,377,593.44	3.63
52	600486	扬农化工	84,314,926.15	3.63
53	603077	和邦生物	82,666,331.20	3.56
54	600988	赤峰黄金	82,497,644.34	3.55
55	300570	太辰光	81,325,264.62	3.50
56	002318	久立特材	76,837,903.87	3.31
57	002600	领益智造	75,899,510.33	3.27

58	000959	首钢股份	75,466,342.17	3.25
59	603113	金能科技	75,344,005.56	3.24
60	600460	士兰微	75,106,420.98	3.23
61	688303	大全能源	74,036,650.86	3.19
62	600282	南钢股份	73,128,526.81	3.15
63	300014	亿纬锂能	71,930,414.80	3.10
64	601918	新集能源	71,670,331.51	3.09
65	600111	北方稀土	71,376,635.04	3.07
66	601168	西部矿业	71,013,633.04	3.06
67	600188	兖矿能源	69,036,676.50	2.97
68	601678	滨化股份	68,169,299.38	2.93
69	002312	川发龙蟒	67,930,403.25	2.92
70	600699	均胜电子	67,676,729.09	2.91
71	002532	天山铝业	63,242,933.80	2.72
72	002541	鸿路钢构	63,194,592.06	2.72
73	300384	三联虹普	63,129,259.92	2.72
74	603260	合盛硅业	58,609,754.09	2.52
75	300568	星源材质	57,872,088.96	2.49
76	300648	星云股份	55,547,347.20	2.39
77	601100	恒立液压	51,468,295.00	2.22
78	300118	东方日升	47,261,228.82	2.03

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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	9,076,770,244.58
卖出股票收入（成交）总额	9,247,122,156.38

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

#### 8.5 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)	188,447,069.78	6.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	188,447,069.78	6.51

#### 8.6 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	123107	温氏转债	728,017	98,267,734.66	3.39
2	127045	牧原转债	649,988	90,179,335.12	3.11

#### 8.7 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。

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

本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂不投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1 报告期内**，本基金投资的前十名证券的牧原股份（证券代码：002714.SZ）发行主体的独立董事项振华在报告编制日前一年内因信息披露违法违规受到中国证监会的处罚，发行主体的高管秦英林在报告编制日前一年内因未依法履职受到中国证监会的处罚。除上述情况外，**本基金投资的其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

本基金投资上述标的的投资决策程序为：

- 1、投资决策委员会确定每个产品的基本投资逻辑；
- 2、投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
- 3、基金经理拟订所管理产品的投资计划与方案；
- 4、金融工程小组对基金经理/投资经理的投资计划进行风险评价，并向投资决策委员会提交评估报告；
- 5、投资决策委员会对基金经理/投资经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；
- 6、根据决策纪要，基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施；
- 7、中央交易室按有关交易规则执行基金经理/投资经理下达的交易指令，并将有关信息进行反馈；
- 8、基金经理/投资经理定期检讨投资组合的运作成效；
- 9、金融工程小组定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理/投资经理出具绩效与风险评估报告。

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

### 8.12.3 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	1,399,680.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	179,605.26
5	应收申购款	6,201,655.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,780,941.19

### 8.12.4 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	123107	温氏转债	98,267,734.66	3.39

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	持有份额	占总份

			额比例		额比例
160,407	3,800.62	206,173,845.28	33.820%	403,471,924.81	66.180%

## 9.2 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	634,056.55	0.10%

## 9.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年12月01日)基金份额总额	1,058,572,878.12
本报告期期初基金份额总额	628,578,735.29
本报告期基金总申购份额	974,580,543.16
减：本报告期基金总赎回份额	993,513,508.36
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	609,645,770.09

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，基金管理人于2021年9月3日聘任吴林惠先生担任公司董事长职务，原董事长夏理芬先生于2021年9月3日离任；基金管理人副总经理汪海先生于2021年10月15日代为履行总经理职务，原总经理王家俊先生于2021年10月15日离任。

2、本报告期内，中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士

的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为十万元，目前该事务所已为本基金提供审计服务的年限为10年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	158,781,114.38	0.87%	112,940.87	0.80%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	1,087,984,117.84	5.94%	1,004,136.52	7.09%	-

长江证券	2	1,246,235,688.63	6.81%	895,694.37	6.32%	-
东北证券	2	1,041,225,872.69	5.69%	752,042.08	5.31%	-
东方财富证券股份有限公司	2	191,871,420.90	1.05%	136,479.02	0.96%	-
东方证券	2	583,273,631.08	3.19%	422,190.01	2.98%	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	452,834,001.17	2.47%	323,148.86	2.28%	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	1,293,088,201.70	7.06%	926,663.67	6.54%	-
广发证券	2	842,058,047.82	4.60%	775,298.90	5.47%	-
国金证券	2	535,604,920.02	2.93%	491,991.14	3.47%	-
国联证券	2	482,868,609.84	2.64%	346,835.77	2.45%	-
国盛证券	2	1,708,989,408.26	9.34%	1,230,654.97	8.69%	-
国泰君安	2	272,841,126.47	1.49%	198,163.92	1.40%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	418,915,713.65	2.29%	381,759.52	2.69%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	1,030,408,772.07	5.63%	743,716.32	5.25%	-
华融证券	2	54,123,020.25	0.30%	38,497.47	0.27%	-
华泰	2	-	-	-	-	-



证券						
江海证券	2	803,302,271.99	4.39%	584,508.19	4.13%	-
开源证券	2	147,243,207.77	0.80%	105,949.22	0.75%	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	162,822,423.76	0.89%	115,816.32	0.82%	-
天风证券	2	1,000,198,540.43	5.46%	916,650.24	6.47%	-
西部证券	2	374,241,695.33	2.04%	266,197.05	1.88%	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	105,478,878.48	0.58%	98,234.11	0.69%	-
信达证券	2	128,921,924.34	0.70%	94,278.36	0.67%	-
兴业证券	2	2,419,676,653.26	13.22%	1,752,834.14	12.37%	-
银河证券	2	40,125,054.48	0.22%	28,923.17	0.20%	-
招商证券	2	308,178,395.82	1.68%	287,004.82	2.03%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	220,377,040.93	1.20%	161,161.40	1.14%	-
中信证券	2	88,182,006.33	0.48%	82,123.52	0.58%	-

中原证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	246,558,587.36	1.35%	180,307.68	1.27%	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
中信建投证券	4	857,100,051.94	4.68%	711,908.16	5.03%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	15,978,904.07	0.74%	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	24,558,143.41	1.14%	-	-	-	-	-	-
长江证券	200,825,8	9.31%	-	-	-	-	-	-

	81.53							
东北证券	273,061,696.59	12.65%	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	26,949,251.20	1.25%	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	69,543,297.70	3.22%	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	168,162,834.72	7.79%	-	-	-	-	-	-
广发证券	232,580,866.54	10.78%	-	-	-	-	-	-
国金证券	33,095,941.56	1.53%	-	-	-	-	-	-
国联证券	75,885,627.25	3.52%	-	-	-	-	-	-
国盛证券	368,581,248.16	17.08%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	159,903,512.86	7.41%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	52,099,662.69	2.41%	-	-	-	-	-	-
天风证券	13,475,656.39	0.62%	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-

湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	37,216,852.10	1.72%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	296,345,762.85	13.73%	-	-	-	-	-	-
银河证券	34,051,690.40	1.58%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	75,460,733.30	3.50%	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-1-4
2	《财通价值动量混合型证券投资基金2020年第4季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-1-21

3	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-1-22
4	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-1-26
5	《关于财通价值动量混合型证券投资基金参加宁波银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-3-13
6	《关于财通价值动量混合型证券投资基金增加山西证券股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-3-25
7	《财通价值动量混合型证券投资基金2020年年度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-3-27
8	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国金理益财富基金销售有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-4-2
9	《财通价值动量混合型证券投资基金2021年第一季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-4-21
10	《关于财通价值动量混合型证券投资基金增加中原证券股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-5-12
11	《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合调整停牌股票估值方法的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-5-12
12	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-5-14

13	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-6-11
14	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-6-18
15	《财通基金管理有限公司关于根据<公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）>修订旗下部分公募基金基金合同的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-6-26
16	《财通价值动量混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年6月26日公告）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-6-26
17	《财通价值动量混合型证券投资基金基金合同（2021年6月26日公告）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-6-26
18	《财通价值动量混合型证券投资基金托管协议（2021年6月26日公告）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-6-26
19	《财通基金管理有限公司关于旗下基金2021年半年度资产净值的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-7-1
20	《财通价值动量混合型证券投资基金2021年第二季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-7-20
21	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-7-31
22	《财通基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2021年风险评价结果的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-8-10

23	《关于调整财通价值动量混合型证券投资基金单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及账户最低保留份额限制的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-8-24
24	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-8-27
25	《财通价值动量混合型证券投资基金2021年中期报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-8-28
26	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-9-1
27	《财通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-9-4
28	《关于财通价值动量混合型证券投资基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-9-24
29	《财通基金管理有限公司关于公司变更法定代表人并完成工商变更登记的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-9-25
30	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国光大银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-12
31	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-16
32	《财通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-16

33	《财通基金管理有限公司关于副总经理代为履行总经理职务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-16
34	《财通价值动量混合型证券投资基金2021年第3季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-26
35	《财通基金管理有限公司关于高级管理人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-30
36	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国信证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-3
37	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天风证券股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-5
38	《关于财通价值动量混合型证券投资基金参加长城国瑞证券有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-18
39	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金在泰信财富基金销售有限公司开通定期定额投资及转换业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-19
40	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2022倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-22
41	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-22
42	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-22

## §12 影响投资者决策的其他重要信息



### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、财通价值动量混合型证券投资基金基金合同；
- 3、财通价值动量混合型证券投资基金基金托管协议；
- 4、财通价值动量混合型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心41楼。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>

财通基金管理有限公司  
二〇二二年三月二十九日