

财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 27 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

根据基金合同约定，本基金的封闭运作期于2022年7月10日届满，本基金自2022年7月11日起转为上市开放式基金（LOF），并接受场外、场内申购赎回。本基金名称由“财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金”变更为“财通科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。基金更名后，场内简称仍为“科创财通”，扩位证券简称变更为“财通科创LOF”，场外简称变更为“财通科创主题灵活配置混合（LOF）”，基金代码仍为“501085”。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至2022年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	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.....	11
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.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	48
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
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.....	55

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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§9 开放式基金份额变动	58
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合
场内简称	财通科创3年封闭
基金主代码	501085
交易代码	501085
基金运作方式	契约型。本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期自基金合同生效日起至三年后的年度对日的前一日止。在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务。
基金合同生效日	2019年07月11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	775,602,303.23份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年02月07日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法，采用“自上而下”的资产配置方法确定各类资产的配置比例。本基金主要投资于科创主题企业，科创主题企业是指符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业。本基金将利用多因素选股法，综合考察股票所属行业发展空间、企业成长能力与增长质量、企业管理团队与激励机制、企业创新能力和竞争壁垒、企业估值水平等多种因素，挑选出优质个股，构建核

	<p>心组合。</p> <p>对于科创板股票，本基金除按照上述原则精选个股外，还将多维度分析公司科技创新能力，具体包括研发投入绝对额及营收占比、研发人员数量、单人产出、研发团队组织模式和激励方式等，重点考察公司能否通过持续不断的研发投入，实现高质量可持续增长。封闭运作期内，本基金将积极关注并深入分析和论证战略配售股票的投资机会，通过综合分析行业景气度、企业的基本面、估值水平等多方面的因素，结合未来市场走势判断，精选符合国家战略、掌握核心技术、市场认可度高的企业进行战略配售。债券投资方面，本基金主要采用久期调整策略、收益率曲线配置策略、信用债券投资策略、息差策略。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中国战略新兴产业成份指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品。本基金可投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。本基金封闭运作期内可以参与科创板发行人战略配售股票投资，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

<p>项目</p>	<p>基金管理人</p>	<p>基金托管人</p>
-----------	--------------	--------------

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	吴林惠	郭明
	联系电话	021-20537888	010-66105799
	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-820-9888	95588	
传真	021-20537999	010-66105798	
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区复兴门内大街55号	
办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼	北京市西城区复兴门内大街55号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	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	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ctfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
	(2022年01月01日-2022年06月30日)

本期已实现收益	33,316,230.68
本期利润	64,524,201.05
加权平均基金份额本期利润	0.0832
本期加权平均净值利润率	4.80%
本期基金份额净值增长率	4.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)
期末可供分配利润	562,246,905.82
期末可供分配基金份额利润	0.7249
期末基金资产净值	1,395,932,651.36
期末基金份额净值	1.7998
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	79.98%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	12.14%	1.80%	11.43%	1.18%	0.71%	0.62%
过去三个月	-3.86%	2.15%	7.12%	1.54%	-10.98%	0.61%
过去六个月	4.85%	2.13%	-8.11%	1.44%	12.96%	0.69%
过去一年	12.49%	2.16%	-13.03%	1.24%	25.52%	0.92%

自基金合同生效起至今	79.98%	2.05%	63.16%	1.27%	16.82%	0.78%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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：中国战略新兴产业成份指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%。

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

财通科创主题灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年07月11日-2022年06月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2019年7月11日；

(2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月，截至建仓期末及本报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

§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出资，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2022年6月30日，公司员工共计186人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在12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	公司总经理助理兼基金投资部总监、本基金的基金经理	2019-07-11	-	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。
张胤	本基金的基金经理	2021-09-27	-	10年	复旦大学材料物理与化学硕士。历任万家基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司高级研究员。2020年7月加入财通基金管理有限公司，曾任基金投资部基金经理助理，现任基金投资部基

					金经理。
--	--	--	--	--	------

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)金梓才于2022年8月5日卸任本基金的基金经理，由张胤单独管理本基金。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本投资组合为主动型基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们在前期的各个期间的财报中不断论述了投资理念和看好的方向，所幸我们在历年的投资都坚持了正确的方向，并获取了相对令人满意的结果。但我们认为2022年市场的投资难度在加大，因此，建议投资者在市场没有出现系统性风险的时候，忽略短期波动，坚定持基，相信专业，我们将不断努力寻找结构性投资机会，努力为投资者创造价值。经过了上半年估值的修复，下半年仅仅依靠估值修复而获取的收益空间已然不大，因此，我们认为未来能够获得超额收益的品种应该分为两类，一类是确定性景气回升的行业，另一类则是行业景气平稳，盈利增长较快，并且确定性较高的品种。我们未来的投资也将围绕这两个思路去寻找投资机会，争取为投资者创造更大的价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合基金份额净值为1.7998元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.85%，同期业绩比较基准收益率为-8.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年一季度末疫情因素对我国的经济和社会都产生了较大影响，同时也对我们身处上海的基金管理者来说是一次重要的考验。而随着疫情得到控制，大家逐步回到正常的生活中，社会经济活动也逐步恢复正常。站在这个时点上，我们对于国家下半年经济发展和财政政策都抱有比较乐观的预期，也建议投资者在这个时点忽略短期波动，坚定持基，相信专业，我们将不断努力寻找结构性投资机会，力争为投资者创造价值。

在下一季度配置思路上，我会关注以下几个重要方向：

生物医药：随着风险的持续释放，不少生物医药标的估值回落到具备吸引力的水平线，长线来看，中国在需求增长（老龄化）、支付能力提升（医保增长+消费升级），

无论是刚性治疗需求还是政策支持，或都将助推医药需求的快速增长。医药作为真正的刚需，需求弹性较小，与宏观经济的相关度较低，行业周期性弱，值得我们重点关注。在药品领域，创新仍将是未来不变的主题，整体来看健全体系、补齐公共卫生短板将成为发展方向，因此我们认为长期来看医药或将成为“新基建”的重要一环，相关产业链有望迎来长期投入和建设。我们认为下一阶段需要重点关注随着疫情逐步得到控制后最先复苏的产业机会：民族中药、疫苗及医疗服务有望迎来布局机会。

消费：消费需求在国民经济中的占比会保持长期持续提升，是“内循环”的重要部分，背后核心的驱动因素是人均收入和消费能力的提升。随着疫情的解封和暑期旺季到来，部分旅游度假类和商务出行类消费需求有望迎来反弹，因此我们目前相对看好前期受疫情影响较大，有修复弹性的商务及景区酒店等方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

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，基金管理人旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。本报告期内本基金未进行过利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的管理人--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、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对财通基金管理有限公司编制和披露的财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2022年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	361,720,929.08	288,206,103.24
结算备付金		412,024.52	4,599,711.23
存出保证金		347,026.12	838,302.97
交易性金融资产	6.4.7.2	1,315,772,831.43	1,055,263,175.45
其中：股票投资		1,272,579,797.65	1,055,263,175.45
基金投资		-	-
债券投资		43,193,033.78	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		27,364,475.78	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	25,762.17
资产总计		1,705,617,286.93	1,348,933,055.06
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		305,845,829.67	13,133,432.89
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,604,309.03	1,706,998.13
应付托管费		267,384.81	284,499.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		155.14	35.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,966,956.92	2,399,638.35
负债合计		309,684,635.57	17,524,604.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	775,602,303.23	775,602,303.23
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	620,330,348.13	555,806,147.08
净资产合计		1,395,932,651.36	1,331,408,450.31
负债和净资产总计		1,705,617,286.93	1,348,933,055.06

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2022年6月30日，基金份额净值1.7998元，基金份额总额775,602,303.23份。

6.2 利润表

会计主体：财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至	上年度可比期间 2021年01月01日至202

		2022年06月30日	1年06月30日
一、营业总收入		76,263,538.14	77,158,009.26
1.利息收入		282,415.67	277,050.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	282,415.67	277,050.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		44,773,152.10	201,457,033.79
其中：股票投资收益	6.4.7.10	45,805,043.84	189,104,557.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-1,882,169.87	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	850,278.13	12,352,476.53
以摊余成本计量的		-	-
金融资产终止确认		-	-
产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	31,207,970.37	-124,576,074.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
减：二、营业总支出		11,739,337.09	14,937,058.01

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,968,715.85	9,243,548.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,661,452.60	1,540,591.38
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		72.70	-
8. 其他费用	6.4.7.17	109,095.94	4,152,918.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		64,524,201.05	62,220,951.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		64,524,201.05	62,220,951.25
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		64,524,201.05	62,220,951.25

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	775,602,303.2 3	-	555,806,147.0 8	1,331,408,450. 31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	775,602,303.2 3	-	555,806,147.0 8	1,331,408,450. 31
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	64,524,201.05	64,524,201.05
(一)、综合收益总额	-	-	64,524,201.05	64,524,201.05
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	775,602,303.2 3	-	620,330,348.1 3	1,395,932,651. 36
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	775,602,303.2 3	-	403,150,086.4 0	1,178,752,389. 63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	775,602,303.2 3	-	403,150,086.4 0	1,178,752,389. 63
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填 列)	-	-	62,220,951.25	62,220,951.25
(一)、综合收益总 额	-	-	62,220,951.25	62,220,951.25
(二)、本期基金份 额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回 款	-	-	-	-
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	775,602,303.2 3	-	465,371,037.6 5	1,240,973,340. 88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

徐春庭

刘为臻

刘为臻

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

财通科创主题3年封闭运作灵活配置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[2019]1014号《关于准予财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2019年7月11日生效，首次设立募集规模为775,602,303.23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为财通基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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（包括科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金封闭运作期内，股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为0%-100%，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。转为上市开放式基金（LOF）后，股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为0%-95%，其中，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基

金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 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。

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

根据《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币288,206,103.24元，自应收利息转入的重分类金额为人民币23,314.97元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币288,229,418.21元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币4,599,711.23元，自应收利息转入的重分类金额为人民币2,069.90元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币4,601,781.13元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币838,302.97元，自应收利息转入的重分类金额为人民币377.30元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币838,680.27元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币25,762.17元，转出至银行存款的重分类金额为人民币23,314.97元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币2,069.90元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币377.30元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，

已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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。

5.个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	
活期存款	361,720,929.08	
等于：本金	361,713,579.27	
加：应计利息	7,349.81	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	361,720,929.08	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,211,071,166.73	-	1,272,579,797.65	61,508,630.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	46,581,068.51	37,153.88	43,193,033.78	-3,425,188.61
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	46,581,068.51	37,153.88	43,193,033.78	-3,425,188.61
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,257,652,235.24	37,153.88	1,315,772,831.43	58,083,442.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	1,857,860.98
其中：交易所市场	1,857,860.98

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	1,966,956.92

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	775,602,303.23	775,602,303.23
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	775,602,303.23	775,602,303.23

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

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
本期期初	528,930,675.14	26,875,471.94	555,806,147.08
本期利润	33,316,230.68	31,207,970.37	64,524,201.05
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	562,246,905.82	58,083,442.31	620,330,348.13

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日

活期存款利息收入	255,034.68
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	22,045.80
其他	5,335.19
合计	282,415.67

注：本基金本报告期内未投资于定期存款。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	1,969,595,023.06
减：卖出股票成本总额	1,918,146,696.57
减：交易费用	5,643,282.65
买卖股票差价收入	45,805,043.84

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	20,184.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,902,354.12
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	-1,882,169.87

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	32,186,361.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,064,074.87
减：应计利息总额	20,685.25
减：交易费用	3,955.69
买卖债券差价收入	-1,902,354.12

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	850,278.13
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	850,278.13

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1.交易性金融资产	31,207,970.37
——股票投资	34,633,158.98
——债券投资	-3,425,188.61
——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	31,207,970.37

6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	109,095.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至2022年6月30日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据基金合同约定，本基金的封闭运作期于2022年7月10日届满，本基金自2022年7月11日起转为上市开放式基金（LOF），并接受场外、场内申购赎回。本基金名称由“财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金”变更为“财通科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。基金更名后，场内简称仍为“科创财通”，扩位证券简称变更为“财通科创LOF”，场外简称变更为“财通科创主题灵活配置混合（LOF）”，基金代码仍为“501085”。

除此之外，截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财通基金管理有限公司("财通基金")	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
财通证券股份有限公司("财通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例

财通证券	60,554,206.18	1.49%	59,471,318.19	1.99%
------	---------------	-------	---------------	-------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	56,394.89	1.71%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	54,196.55	2.36%	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,968,715.85	9,243,548.39
其中：支付销售机构的客户维护费	2,630,027.01	2,671,621.73

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

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,661,452.60	1,540,591.38

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	361,720,929.08	255,034.68	184,259,539.02	254,319.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

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

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

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688400	凌云光	2022-06-27	1个月内(含)	认购新发证券	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-
688322	奥比中光	2022-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
301175	中科环保	2022-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内(含)	认购新发证券	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	1个月内(含)	认购新发证券	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
688237	超卓航科	2022-06-24	1个月内(含)	认购新发证券	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内(含)	认购新发证券	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月以上	新股限售	72.88	31.38	1,107	80,678.16	34,737.66	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月以上	新股限售	17.27	14.83	3,427	59,184.29	50,822.41	-
301200	大族数控	2022-02-1	6个月以上	新股限售	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-

		8								
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月以上	新股限售	173.98	87.82	241	41,929.18	21,164.62	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月以上	新股限售	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月以上	新股限售	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月以上	新股限售	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月以上	新股限售	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月以上	新股限售	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月以上	新股限售	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月以上	新股限售	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月以上	新股限售	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月以上	新股限售	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月以上	新股限售	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月以上	新股限售	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-

3011 16	益客 食品	2022 -01-1 0	6个月以 上	新股 限售	11.40	20.46	577	6,57 7.80	11,80 5.42	-
3012 37	和顺 科技	2022 -03-1 6	6个月以 上	新股 限售	56.69	41.86	261	14,79 6.09	10,92 5.46	-
3011 37	哈焊 华通	2022 -03-1 4	6个月以 上	新股 限售	15.37	15.99	644	9,89 8.28	10,29 7.56	-
3011 10	青木 股份	2022 -03-0 4	6个月以 上	新股 限售	63.10	39.85	202	12,74 6.20	8,04 9.70	-
3012 33	盛帮 股份	2022 -06-2 4	6个月以 上	新股 限售	41.52	41.52	158	6,56 0.16	6,56 0.16	-
3012 36	软通 动力	2022 -06-0 9	1-6个月 (含)	新股 限售 -送 股	-	31.38	554	-	17,38 4.52	-
3012 19	腾远 钴业	2022 -05-2 4	1-6个月 (含)	新股 限售 -送 股	-	87.82	193	-	16,94 9.26	-

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因暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间

同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期自基金合同生效日起至三年后的年度对日的前一日止，在封闭期内不办理申购与赎回业务。封闭运作期届满后，即本基金基金合同生效日起满三年的对日起，本基金转为上市开放式基金（LOF）。针对开放时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，因此除在本报告附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均处于封闭期，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	361,720,929.08	-	-	-	-	-	361,720,929.08
结算备付金	412,024.52	-	-	-	-	-	412,024.52
存出保证金	347,026.12	-	-	-	-	-	347,026.12
交易性金融资产	-	-	-	-	43,193,033.78	1,272,579,797.65	1,315,772,831.43
应收清算款	-	-	-	-	-	27,364,475.78	27,364,475.78
资产总计	362,479,979.72	-	-	-	43,193,033.78	1,299,944,273.43	1,705,617,286.93
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	305,845,829.67	305,845,829.67

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,604,309.03	1,604,309.03
应付托管费	-	-	-	-	-	267,384.81	267,384.81
应交税费	-	-	-	-	-	155.14	155.14
其他负债	-	-	-	-	-	1,966,956.92	1,966,956.92
负债总计	-	-	-	-	-	309,684,635.57	309,684,635.57
利率敏感度缺口	362,479,979.72	-	-	-	43,193,033.78	990,259,637.86	1,395,932,651.36
上年度末 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	288,206,103.24	-	-	-	-	-	288,206,103.24
结算备付金	4,599,711.23	-	-	-	-	-	4,599,711.23
存出保证金	838,302.97	-	-	-	-	-	838,302.97
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,055,263,175.45	1,055,263,175.45
应收利息	-	-	-	-	-	25,762.17	25,762.17
资产总计	293,644,117.44	-	-	-	-	1,055,288,937.62	1,348,933,055.06

应付 证券 清算 款	-	-	-	-	-	13,133,432.89	13,133,432.89
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	1,706,998.13	1,706,998.13
应付 托管 费	-	-	-	-	-	284,499.69	284,499.69
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	2,179,638.35	2,179,638.35
应交 税费	-	-	-	-	-	35.69	35.69
其他 负债	-	-	-	-	-	220,000.00	220,000.00
负债 总计	-	-	-	-	-	17,524,604.75	17,524,604.75
利率 敏感 度缺 口	293,644,117. 44	-	-	-	-	1,037,764,33 2.87	1,331,408,45 0.31

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所

上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中，本基金封闭运作期内，股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为0%-100%，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。转为上市开放式基金（LOF）后，股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为0%-95%，其中，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。

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 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,272,579,797.65	91.16	1,055,263,175.45	79.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	43,193,033.78	3.09	-	-
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	1,315,772,831.43	94.25	1,055,263,175.45	79.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准增加1%	9,302,154.32	8,796,972.04
	业绩比较基准减少1%	-9,302,154.32	-8,796,972.04

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,314,002,931.00	1,029,204,639.27
第二层次	1,318,609.45	380,229.35

第三层次	451,290.98	25,678,306.83
合计	1,315,772,831.43	1,055,263,175.45

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,272,579,797.65	74.61
	其中：股票	1,272,579,797.65	74.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	43,193,033.78	2.53
	其中：债券	43,193,033.78	2.53
	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	362,132,953.60	21.23
8	其他各项资产	27,711,501.90	1.62
9	合计	1,705,617,286.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	129,651,497.75	9.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	598,267,300.93	42.86
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	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	111,090,488.82	7.96
H	住宿和餐饮业	146,647,655.74	10.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	315,840.01	0.02
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	69,548,512.00	4.98
N	水利、环境和公共设施管理业	30,595,582.24	2.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	141,164,959.45	10.11
R	文化、体育和娱乐业	45,276,559.55	3.24
S	综合	-	-
	合计	1,272,579,797.65	91.16

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	601012	隆基绿能	1,071,040	71,363,395.20	5.11
2	002371	北方华创	256,000	70,942,720.00	5.08
3	600763	通策医疗	405,000	70,648,200.00	5.06
4	300015	爱尔眼科	1,570,770	70,323,372.90	5.04
5	603259	药明康德	668,800	69,548,512.00	4.98
6	300750	宁德时代	126,850	67,737,900.00	4.85
7	002487	大金重工	1,599,493	66,746,842.89	4.78
8	600438	通威股份	1,061,800	63,559,348.00	4.55
9	002100	天康生物	6,519,490	63,369,442.80	4.54
10	002124	天邦食品	9,071,889	60,963,094.08	4.37
11	600754	锦江酒店	953,252	59,959,550.80	4.30
12	601111	中国国航	5,060,212	58,749,061.32	4.21
13	600258	首旅酒店	2,123,700	52,667,760.00	3.77
14	600029	南方航空	7,160,250	52,341,427.50	3.75
15	002840	华统股份	2,859,644	50,472,716.60	3.62
16	300144	宋城演艺	2,949,613	45,276,559.55	3.24
17	002548	金新农	5,980,970	40,072,499.00	2.87
18	603363	傲农生物	2,074,230	38,393,997.30	2.75
19	603218	日月股份	1,499,180	38,079,172.00	2.73
20	601007	金陵饭店	3,041,625	34,005,367.50	2.44
21	603477	巨星农牧	1,328,100	31,847,838.00	2.28
22	603136	天目湖	1,057,857	30,318,181.62	2.17
23	002714	牧原股份	475,724	26,293,265.48	1.88
24	002567	唐人神	2,916,538	24,819,738.38	1.78
25	300498	温氏股份	495,411	10,547,300.19	0.76
26	688001	华兴源创	42,063	1,144,954.86	0.08
27	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02

28	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.02
29	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
30	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
31	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
32	688667	菱电电控	1,191	172,016.13	0.01
33	688626	翔宇医疗	3,652	121,465.52	0.01
34	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
35	688669	聚石化学	2,681	68,714.03	0.00
36	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
37	688577	浙海德曼	1,503	61,713.18	0.00
38	301236	软通动力	1,661	52,122.18	0.00
39	301217	铜冠铜箔	3,427	50,822.41	0.00
40	688607	康众医疗	1,890	48,535.20	0.00
41	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
42	301219	腾远钴业	434	38,113.88	0.00
43	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
44	688395	正弦电气	1,627	34,215.81	0.00
45	688679	通源环境	3,139	34,089.54	0.00
46	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
47	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
48	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
49	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
50	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
51	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
52	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.00
53	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
54	301179	泽宇智能	295	12,038.95	0.00
55	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
56	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
57	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
58	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00

59	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
60	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
61	600699	均胜电子	112	1,759.52	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002371	北方华创	154,445,798.60	11.60
2	300750	宁德时代	153,657,828.38	11.54
3	600258	首旅酒店	146,070,684.94	10.97
4	603259	药明康德	141,616,988.54	10.64
5	300015	爱尔眼科	141,392,966.59	10.62
6	600763	通策医疗	141,141,609.95	10.60
7	002714	牧原股份	95,279,545.17	7.16
8	601012	隆基绿能	91,626,118.44	6.88
9	000725	京东方A	73,114,459.00	5.49
10	002475	立讯精密	73,003,971.60	5.48
11	600029	南方航空	69,738,981.00	5.24
12	600754	锦江酒店	66,565,054.00	5.00
13	002487	大金重工	66,402,469.05	4.99
14	002124	天邦食品	63,489,864.30	4.77
15	600438	通威股份	62,531,480.17	4.70
16	300498	温氏股份	55,489,993.54	4.17
17	603566	普莱柯	54,857,059.04	4.12
18	002100	天康生物	53,142,999.68	3.99
19	603477	巨星农牧	49,033,778.00	3.68
20	002840	华统股份	44,863,085.16	3.37
21	002548	金新农	39,987,097.23	3.00
22	603218	日月股份	38,224,975.00	2.87

23	300144	宋城演艺	36,526,886.08	2.74
24	603456	九洲药业	28,534,929.36	2.14
25	002567	唐人神	28,208,708.58	2.12
26	603136	天目湖	28,025,036.92	2.10
27	601007	金陵饭店	27,664,557.75	2.08
28	002572	索菲亚	26,796,389.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002714	牧原股份	186,547,430.48	14.01
2	300498	温氏股份	164,306,055.96	12.34
3	600258	首旅酒店	88,156,340.09	6.62
4	002567	唐人神	87,560,752.20	6.58
5	300750	宁德时代	86,627,075.00	6.51
6	603477	巨星农牧	84,085,427.00	6.32
7	002371	北方华创	83,179,265.92	6.25
8	603363	傲农生物	77,331,456.97	5.81
9	002124	天邦食品	75,098,620.30	5.64
10	300015	爱尔眼科	73,440,676.88	5.52
11	600763	通策医疗	73,133,636.00	5.49
12	002475	立讯精密	72,347,137.20	5.43
13	600029	南方航空	72,195,982.49	5.42
14	600754	锦江酒店	72,168,134.76	5.42
15	000725	京东方A	72,136,531.00	5.42
16	603259	药明康德	71,662,303.24	5.38
17	601111	中国国航	70,032,203.00	5.26
18	300604	长川科技	63,944,506.48	4.80
19	002100	天康生物	56,722,853.47	4.26

20	603566	普莱柯	52,043,852.00	3.91
21	002557	洽洽食品	49,472,959.80	3.72
22	688508	芯朋微	41,457,840.22	3.11
23	002840	华统股份	35,931,856.93	2.70
24	002507	涪陵榨菜	31,485,736.05	2.36
25	603456	九洲药业	27,917,539.40	2.10

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,100,830,159.79
卖出股票收入（成交）总额	1,969,595,023.06

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	43,193,033.78	3.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	43,193,033.78	3.09

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127049	希望转2	351,690	43,193,033.78	3.09

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的药明康德（证券代码：603259.SH）股东上海瀛翊投资中心（有限合伙）因涉嫌信息披露违法违规，收到中国证券监督管理委员会调查通知书。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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	347,026.12
2	应收清算款	27,364,475.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,711,501.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127049	希望转2	43,193,033.78	3.09

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
42,130	18,409.74	99,883,782.74	12.88%	675,718,520.49	87.12%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国工商银行股份有限公司—兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	16,211,406.00	4.94%
2	吴迅	13,516,821.00	4.12%
3	谢西就	10,856,366.00	3.31%
4	方晨	9,714,898.00	2.96%
5	尹瑛姬	9,227,229.00	2.81%
6	渤海证券股份有限公司	6,462,573.00	1.97%
7	沈根法	5,823,078.00	1.78%
8	兴证全球基金—建设银行—兴全—建信理财1号FOF集合资产管理计划	4,920,277.00	1.50%

9	杨永玲	4,320,000.00	1.32%
10	厦门福融通资产管理有限公司一厚德永续1号私募基金	3,821,540.00	1.17%

8.3 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	3,289.20	0.0004%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年07月11日)基金份额总额	775,602,303.23
本报告期期初基金份额总额	775,602,303.23
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	775,602,303.23

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，基金管理人于2022年4月8日聘任徐春庭先生担任公司董事、总经理，副总经理汪海先生自2022年4月8日起不再代为履行总经理职务；基金管理人董事长

吴林惠先生于2022年4月22日代为履行督察长职务，原督察长武伟先生于2022年4月22日离任。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	35,462,758.24	0.87%	25,225.49	0.76%	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
新时	1	-	-	-	-	-

代证券						
财通证券	2	60,554,206.18	1.49%	56,394.89	1.71%	-
长江证券	2	92,968,445.86	2.29%	66,126.41	2.00%	-
德邦证券	2	55,956,252.45	1.38%	39,801.92	1.21%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	53,351,646.28	1.31%	39,015.61	1.18%	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	24,425,750.56	0.60%	17,861.87	0.54%	-
国金证券	2	48,907,698.88	1.20%	45,058.77	1.37%	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	366,409,422.59	9.03%	267,324.62	8.10%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	527,854,147.49	13.00%	375,462.08	11.38%	-
华融	2	-	-	-	-	-

证券						
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	46,071,792.00	1.13%	33,695.66	1.02%	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	371,305,519.76	9.15%	344,572.79	10.44%	-
西部证券	2	81,417,181.93	2.01%	57,912.49	1.75%	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	651,116,216.31	16.04%	593,366.88	17.98%	-
中国中投证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	4	344,977,277.23	8.50%	248,829.65	7.54%	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	4	723,352,811.52	17.82%	670,698.00	20.32%	-
兴业证券	4	575,684,118.65	14.18%	419,353.55	12.70%	-
中信建投证券	4	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总 额的 比例		购成 交总 额的 比例		交总 额的 比例		交总 额的 比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	24,542,413.09	23.08%	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	13,736,143.60	12.91%	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	60,436,048.97	56.82%	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	7,643,948.60	7.19%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金风险揭示书	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-07
2	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-22
3	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-29
4	财通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-09
5	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-21

	金2022年第一季度报告		
6	关于深圳前海凯恩斯基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
7	财通基金管理有限公司关于董事长代为履行督察长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-23
8	财通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-23
9	财通基金管理有限公司关于终止部分代销机构代理销售旗下基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-29
10	关于上海尚善基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-15
11	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2022年6月25日公告）	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25
12	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2022年6月25日公告）	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市银城中路68号时代金融中心41楼。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>。

财通基金管理有限公司
二〇二二年八月二十七日