

财通量化核心优选混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 28 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2021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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021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	6
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	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	投资组合报告附注	53
§8	基金份额持有人信息	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§9	开放式基金份额变动	55
§10	重大事件揭示	55
10.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4	基金投资策略的改变	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8	其他重大事件	60
§11	影响投资者决策的其他重要信息	61
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	61
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
§12	备查文件目录	62
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通量化核心优选混合型证券投资基金
基金简称	财通量化核心优选混合
场内简称	-
基金主代码	006157
交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2018年09月17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	6,485,240.55份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金主要通过定量投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>本基金利用多因子选股模型进行选股。多因子选股模型认为每只股票所获得的收益都源于其对各种因子（包括价值、质量、成长、事件驱动、市场等大类）的暴露，以及其本身的特定风险；本基金债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益；本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资；本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性；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、</p>

	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。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
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。

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	武祎
	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	夏理芬	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	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年01月01日- 2021年06月30日）
本期已实现收益	1,367,190.72
本期利润	1,490,310.03
加权平均基金份额本期利润	0.1663
本期加权平均净值利润率	9.54%
本期基金份额净值增长率	8.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2021年06月30日）
期末可供分配利润	5,399,163.99
期末可供分配基金份额利润	0.8325
期末基金资产净值	12,020,474.98
期末基金份额净值	1.8535
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2021年06月30日）
基金份额累计净值增长率	85.35%

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

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

(3)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	3.86%	0.93%	1.12%	0.69%	2.74%	0.24%
过去三个月	10.74%	0.90%	8.41%	0.65%	2.33%	0.25%
过去六个月	8.51%	1.27%	6.61%	0.94%	1.90%	0.33%
过去一年	20.94%	1.31%	15.35%	1.19%	5.59%	0.12%
自基金合同生效起至今	85.35%	1.33%	43.65%	1.41%	41.70%	-0.08%

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：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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



注：(1)本基金合同生效日为2018年09月17日；

(2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月，截至本报告期末，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。

公司现有员工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7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		
朱海东	本基金的基金经理、量化投资一部总监助理（主持工作）	2019-07-16	-	9年	复旦大学理学硕士。历任银河基金量化研究员，平安资管量化投资部研究经理，负责产品投资管理以及量化模型开发工作。2019年6月加入财通基金管理有限公司，现任量化投资一部总监助理（主持工作）、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。

4.2 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

报告期内，本基金组合采用量化模型，控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，追求相对基准的长期稳定的超额收益，并在投资上积极参与新股申购，相对业绩基准创造出了超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通量化核心优选混合基金份额净值为1.8535元，本报告期内，基金份额净值增长率为8.51%，同期业绩比较基准收益率为6.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，PPI与CPI剪刀差位于历史极值附近，经济存在一定的压力，而国内货币环境相对宽松，在这样的宏观背景下，我们看好成长风格继续优秀表现。同时，我们判断消费板块参与性价比越来越高，值得关注。对于周期板块，我们认为其性价比正在逐步下降。

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》。

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。

4.7 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，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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个交易日基金份额持有人数量不满200人的情况出现；本基金资产净值于2020年6月30日至2021年6月30日期间连续245个工作日低于5000万元。本基金管理人已根据法规要求向中国证监会报告并提出解决方案，后续将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

§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量化核心优选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，财通量化核心优选混合型证券投资基金的管理人--财通基金管理有限公司在财通量化核心优选混合型证券投资基金的投资运作、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量化核心优选混合型证券投资基金2021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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：财通量化核心优选混合型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	748,186.08	1,925,577.96
结算备付金		104,065.55	242,114.99
存出保证金		7,742.30	22,296.88
交易性金融资产	6.4.7.2	11,174,456.56	25,392,692.47
其中：股票投资		11,172,992.96	25,392,692.47
基金投资		-	-
债券投资		1,463.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		95,784.51	332,735.33
应收利息	6.4.7.5	115.71	295.33

应收股利		-	-
应收申购款		99.87	14,557.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,130,450.58	27,930,270.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		69.14	365,133.30
应付赎回款		27,611.23	196,403.66
应付管理人报酬		14,797.79	36,516.37
应付托管费		2,466.31	6,086.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	40,235.16	128,473.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	24,795.97	170,165.41
负债合计		109,975.60	902,777.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,485,240.55	15,823,095.67
未分配利润	6.4.7.10	5,535,234.43	11,204,397.11
所有者权益合计		12,020,474.98	27,027,492.78
负债和所有者权益总计		12,130,450.58	27,930,270.75

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6月30日，基金份额净值1.8535元，基金份额总额6,485,240.55份。

6.2 利润表

会计主体：财通量化核心优选混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		1,860,135.68	11,132,612.63
1.利息收入		3,274.82	38,611.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,274.45	38,611.28
债券利息收入		0.37	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,718,638.41	11,811,445.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,620,558.06	11,510,425.27
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	98,080.35	301,020.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	123,119.31	-879,994.60
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	15,103.14	162,550.43
减：二、费用		369,825.65	3,164,093.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	116,672.18	709,342.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,445.40	118,223.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	208,912.88	2,251,991.64
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	24,795.19	84,535.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,490,310.03	7,968,519.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,490,310.03	7,968,519.37

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通量化核心优选混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,823,095.67	11,204,397.11	27,027,492.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,490,310.03	1,490,310.03
三、本期基金份额交	-9,337,855.12	-7,159,472.71	-16,497,327.83

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	1,215,227.92	900,421.49	2,115,649.41
2.基金赎回款	-10,553,083.04	-8,059,894.20	-18,612,977.24
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)	6,485,240.55	5,535,234.43	12,020,474.98
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	95,845,364.11	30,525,320.88	126,370,684.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,968,519.37	7,968,519.37
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)	-69,150,764.87	-24,275,747.55	-93,426,512.42
其中: 1.基金申购款	39,567,805.56	13,700,525.68	53,268,331.24
2.基金赎回款	-108,718,570.43	-37,976,273.23	-146,694,843.66
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)	26,694,599.24	14,218,092.70	40,912,691.94
---------------------	---------------	---------------	---------------

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:

王家俊

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

财通量化核心优选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[2018]1016号《关于准予财通量化核心优选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2018年9月17日生效,首次设立募集规模为400,366,734.00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和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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、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、资产支持证券及其他经中国证监会允许投资的债券)、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、权证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。

基金的投资组合比例为:股票投资(含存托凭证)占基金资产的比例为60%-95%,权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%,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,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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(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>》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。

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2021年6月30日的财务状况以及自2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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。

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 2021年06月30日
活期存款	748,186.08
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	748,186.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,693,703.68	11,172,992.96	479,289.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券 交易所市场	1,000.00	1,463.60	463.60

	银行间市场	-	-	-
	合计	1,000.00	1,463.60	463.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		10,694,703.68	11,174,456.56	479,752.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	70.07
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	42.12
应收债券利息	0.37
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	-
其他	3.15
合计	115.71

注：其他项目为交易所结算保证金的应收利息

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	40,235.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,235.16

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.78
预提费用	24,795.19
合计	24,795.97

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,823,095.67	15,823,095.67
本期申购	1,215,227.92	1,215,227.92
本期赎回（以“-”号填列）	-10,553,083.04	-10,553,083.04
本期末	6,485,240.55	6,485,240.55

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,262,316.67	-57,919.56	11,204,397.11
本期利润	1,367,190.72	123,119.31	1,490,310.03
本期基金份额交易产生的变动数	-7,230,343.40	70,870.69	-7,159,472.71
其中：基金申购款	949,172.68	-48,751.19	900,421.49
基金赎回款	-8,179,516.08	119,621.88	-8,059,894.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,399,163.99	136,070.44	5,535,234.43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	2,073.46
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	1,096.78
其他	104.21
合计	3,274.45

6.4.7.12 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06月30日
卖出股票成交总额	84,395,569.31
减：卖出股票成本总额	82,775,011.25
买卖股票差价收入	1,620,558.06

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期未有债券买卖差价收入。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	98,080.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	98,080.35

6.4.7.18 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06月30日
1.交易性金融资产	123,119.31
——股票投资	122,655.71
——债券投资	463.60
——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	123,119.31

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	15,103.14
合计	15,103.14

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	208,912.88
银行间市场交易费用	-
合计	208,912.88

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
合计	24,795.19

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2021年6月30日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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、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
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

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**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	116,672.18	709,342.48
其中：支付销售机构的客户维护费	23,986.51	126,539.54

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	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年06月30日	2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,445.40	118,223.78

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年06月30日		2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	748,186.08	2,073.46	13,806,824.80	26,990.12

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

6.4.10.7.2 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

本基金本报告期末无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——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 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。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人

在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注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。

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 2021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	748,186.08	-	-	-	-	-	748,186.08
结算 备付 金	104,065.55	-	-	-	-	-	104,065.55
存出 保证	7,742.30	-	-	-	-	-	7,742.30

金							
交易性金融资产	-	-	-	-	1,463.60	11,172,992.96	11,174,456.56
应收证券清算款	-	-	-	-	-	95,784.51	95,784.51
应收利息	-	-	-	-	-	115.71	115.71
应收申购款	-	-	-	-	-	99.87	99.87
资产总计	859,993.93	-	-	-	1,463.60	11,268,993.05	12,130,450.58
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	69.14	69.14
应付赎回款	-	-	-	-	-	27,611.23	27,611.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,797.79	14,797.79
应付托管费	-	-	-	-	-	2,466.31	2,466.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	40,235.16	40,235.16
其他负债	-	-	-	-	-	24,795.97	24,795.97
负债总计	-	-	-	-	-	109,975.60	109,975.60
利率敏感度缺	859,993.93	-	-	-	1,463.60	11,159,017.45	12,020,474.98

口							
上年度末 2020 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	1,925,577.96	-	-	-	-	-	1,925,577.96
结算备付金	242,114.99	-	-	-	-	-	242,114.99
存出保证金	22,296.88	-	-	-	-	-	22,296.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,392,692.47	25,392,692.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	332,735.33	332,735.33
应收利息	-	-	-	-	-	295.33	295.33
应收申购款	-	-	-	-	-	14,557.79	14,557.79
资产总计	2,189,989.83	-	-	-	-	25,740,280.92	27,930,270.75
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	365,133.30	365,133.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	196,403.66	196,403.66

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,516.37	36,516.37
应付托管费	-	-	-	-	-	6,086.07	6,086.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	128,473.16	128,473.16
其他负债	-	-	-	-	-	170,165.41	170,165.41
负债总计	-	-	-	-	-	902,777.97	902,777.97
利率敏感度缺口	2,189,989.83	-	-	-	-	24,837,502.95	27,027,492.78

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），因此市场利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投

资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，股票投资（含存托凭证）占基金资产的比例为60%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	11,172,992.96	92.95	25,392,692.47	93.95
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,463.60	0.01	-	-
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	11,174,456.56	92.96	25,392,692.47	93.95

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取决于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及行业比较基准的变动。
----	---

	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06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准增加1%	120,667.26	260,799.27
	业绩比较基准减少1%	-120,667.26	-260,799.27

6.4.14 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6月30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11,174,456.56元，属于第二层次的余额为人民币0.00元，属于第三层次的余额为人民币0.00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25,390,218.73元，属于第二层次的余额为人民币2,473.74元，属于第三层次的余额为人民币0.00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未发生变动。

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。

§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	11,172,992.96	92.11
	其中：股票	11,172,992.96	92.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,463.60	0.01
	其中：债券	1,463.60	0.01
	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	852,251.63	7.03
8	其他各项资产	103,742.39	0.86
9	合计	12,130,450.58	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	125,589.40	1.04
B	采矿业	262,705.16	2.19
C	制造业	8,292,809.62	68.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,217.00	0.68

E	建筑业	59,415.00	0.49
F	批发和零售业	88,066.00	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	241,768.40	2.01
H	住宿和餐饮业	23,320.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	369,229.74	3.07
J	金融业	643,728.60	5.36
K	房地产业	146,162.00	1.22
L	租赁和商务服务业	210,330.00	1.75
M	科学研究和技术服务业	43,957.60	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	123,465.00	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,515.00	0.04
Q	卫生和社会工作	386,739.32	3.22
R	文化、体育和娱乐业	33,912.12	0.28
S	综合	35,063.00	0.29
	合计	11,172,992.96	92.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300677	英科医疗	1,600	199,680.00	1.66
2	600887	伊利股份	5,400	198,882.00	1.65
3	688356	键凯科技	570	187,245.00	1.56
4	002179	中航光电	2,149	169,813.98	1.41
5	300015	爱尔眼科	2,334	165,667.32	1.38
6	600763	通策医疗	400	164,400.00	1.37

7	300124	汇川技术	2,200	163,372.00	1.36
8	600884	杉杉股份	6,900	160,908.00	1.34
9	600406	国电南瑞	6,200	144,088.00	1.20
10	601919	中远海控	4,700	143,538.00	1.19
11	000100	TCL科技	18,700	143,055.00	1.19
12	603486	科沃斯	627	143,006.16	1.19
13	600702	舍得酒业	600	128,268.00	1.07
14	600563	法拉电子	800	126,688.00	1.05
15	000933	神火股份	13,300	125,685.00	1.05
16	300059	东方财富	3,740	122,634.60	1.02
17	002706	良信股份	5,340	120,363.60	1.00
18	000915	华特达因	4,483	119,830.59	1.00
19	603035	常熟汽饰	7,300	118,990.00	0.99
20	688111	金山办公	300	118,440.00	0.99
21	002415	海康威视	1,800	116,100.00	0.97
22	600600	青岛啤酒	1,000	115,650.00	0.96
23	603678	火炬电子	1,700	114,750.00	0.95
24	002001	新和成	4,000	114,720.00	0.95
25	000550	江铃汽车	4,800	112,464.00	0.94
26	600028	中国石化	25,600	111,616.00	0.93
27	002705	新宝股份	4,200	110,250.00	0.92
28	300463	迈克生物	2,600	109,434.00	0.91
29	600346	恒力石化	4,100	107,584.00	0.90
30	300458	全志科技	1,200	105,192.00	0.88
31	300083	创世纪	9,500	104,025.00	0.87
32	300087	荃银高科	4,600	103,086.00	0.86
33	603195	公牛集团	500	101,000.00	0.84
34	300223	北京君正	1,000	100,920.00	0.84
35	002027	分众传媒	10,700	100,687.00	0.84
36	601699	潞安环能	8,300	98,023.00	0.82
37	002430	杭氧股份	2,800	96,852.00	0.81

38	603489	八方股份	400	94,552.00	0.79
39	600475	华光环能	9,250	94,350.00	0.78
40	002106	莱宝高科	8,300	93,375.00	0.78
41	300740	水羊股份	4,400	91,872.00	0.76
42	688016	心脉医疗	200	90,922.00	0.76
43	601888	中国中免	300	90,030.00	0.75
44	000977	浪潮信息	3,200	90,016.00	0.75
45	002833	弘亚数控	2,300	89,125.00	0.74
46	600096	云天化	6,300	88,452.00	0.74
47	002920	德赛西威	800	88,064.00	0.73
48	300394	天孚通信	3,440	87,100.80	0.72
49	000423	东阿阿胶	2,400	86,184.00	0.72
50	000725	京东方 A	13,800	86,112.00	0.72
51	000333	美的集团	1,200	85,644.00	0.71
52	600309	万华化学	700	76,174.00	0.63
53	600036	招商银行	1,400	75,866.00	0.63
54	600031	三一重工	2,600	75,582.00	0.63
55	000596	古井贡酒	300	71,850.00	0.60
56	600837	海通证券	5,900	67,850.00	0.56
57	601717	郑煤机	5,800	67,454.00	0.56
58	600741	华域汽车	2,430	63,836.10	0.53
59	688036	传音控股	300	62,850.00	0.52
60	600409	三友化工	6,200	62,682.00	0.52
61	000858	五粮液	200	59,578.00	0.50
62	600707	彩虹股份	6,300	59,283.00	0.49
63	300143	盈康生命	2,200	56,672.00	0.47
64	000157	中联重科	6,100	56,364.00	0.47
65	600966	博汇纸业	4,200	54,810.00	0.46
66	300750	宁德时代	100	53,480.00	0.44
67	600570	恒生电子	569	53,059.25	0.44
68	600522	中天科技	5,300	53,000.00	0.44

69	603267	鸿远电子	400	51,168.00	0.43
70	603806	福斯特	480	50,462.40	0.42
71	600606	绿地控股	9,000	49,050.00	0.41
72	000776	广发证券	3,200	48,448.00	0.40
73	300760	迈瑞医疗	100	48,005.00	0.40
74	002568	百润股份	500	47,395.00	0.39
75	000961	中南建设	8,000	47,360.00	0.39
76	000568	泸州老窖	200	47,188.00	0.39
77	601636	旗滨集团	2,500	46,400.00	0.39
78	600039	四川路桥	7,300	45,771.00	0.38
79	601318	中国平安	700	44,996.00	0.37
80	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.37
81	600809	山西汾酒	100	44,800.00	0.37
82	601233	桐昆股份	1,800	43,362.00	0.36
83	300146	汤臣倍健	1,300	42,770.00	0.36
84	002241	歌尔股份	1,000	42,740.00	0.36
85	300207	欣旺达	1,300	42,328.00	0.35
86	601375	中原证券	8,100	39,447.00	0.33
87	000661	长春高新	100	38,700.00	0.32
88	600219	南山铝业	10,500	37,800.00	0.31
89	601328	交通银行	7,700	37,730.00	0.31
90	603259	药明康德	240	37,581.60	0.31
91	300122	智飞生物	200	37,346.00	0.31
92	600585	海螺水泥	900	36,945.00	0.31
93	000651	格力电器	700	36,470.00	0.30
94	000059	华锦股份	4,400	35,904.00	0.30
95	002648	卫星石化	900	35,271.00	0.29
96	603225	新凤鸣	1,700	34,510.00	0.29
97	000630	铜陵有色	12,600	34,272.00	0.29
98	300999	金龙鱼	400	33,984.00	0.28
99	603589	口子窖	500	33,845.00	0.28

100	000783	长江证券	4,600	33,672.00	0.28
101	603288	海天味业	260	33,527.00	0.28
102	000039	中集集团	1,800	32,724.00	0.27
103	600664	哈药股份	11,300	32,657.00	0.27
104	603501	韦尔股份	100	32,200.00	0.27
105	600801	华新水泥	1,800	31,626.00	0.26
106	002840	华统股份	3,507	31,598.07	0.26
107	002382	蓝帆医疗	1,500	31,275.00	0.26
108	600066	宇通客车	2,500	31,225.00	0.26
109	300014	亿纬锂能	300	31,179.00	0.26
110	002142	宁波银行	800	31,176.00	0.26
111	002636	金安国纪	1,900	30,818.00	0.26
112	603260	合盛硅业	400	30,764.00	0.26
113	605123	派克新材	400	30,480.00	0.25
114	600688	上海石化	8,100	30,456.00	0.25
115	600295	鄂尔多斯	1,700	30,413.00	0.25
116	600426	华鲁恒升	980	30,331.00	0.25
117	300316	晶盛机电	600	30,300.00	0.25
118	002452	长高集团	5,500	30,030.00	0.25
119	002688	金河生物	4,200	29,904.00	0.25
120	300721	怡达股份	800	29,432.00	0.24
121	601601	中国太保	1,000	28,970.00	0.24
122	688013	天臣医疗	900	28,710.00	0.24
123	600858	银座股份	4,700	28,623.00	0.24
124	002408	齐翔腾达	2,300	28,566.00	0.24
125	600282	南钢股份	7,900	28,124.00	0.23
126	600882	妙可蓝多	400	27,920.00	0.23
126	600201	生物股份	1,600	27,920.00	0.23
128	600011	华能国际	6,600	27,852.00	0.23
129	600862	中航高科	900	27,702.00	0.23
130	300799	左江科技	500	27,400.00	0.23

131	000656	金科股份	4,700	27,213.00	0.23
132	688598	金博股份	100	26,900.00	0.22
133	600166	福田汽车	7,700	26,565.00	0.22
134	601838	成都银行	2,100	26,544.00	0.22
135	600373	中文传媒	2,642	26,050.12	0.22
136	000799	酒鬼酒	100	25,560.00	0.21
137	002032	苏泊尔	400	25,516.00	0.21
138	002594	比亚迪	100	25,100.00	0.21
139	601012	隆基股份	280	24,875.20	0.21
140	603129	春风动力	200	24,816.00	0.21
141	688981	中芯国际	400	24,728.00	0.21
142	600276	恒瑞医药	360	24,469.20	0.20
143	002444	巨星科技	700	23,856.00	0.20
144	000009	中国宝安	1,300	23,751.00	0.20
145	601628	中国人寿	700	23,723.00	0.20
146	300653	正海生物	300	23,490.00	0.20
147	601238	广汽集团	1,800	23,310.00	0.19
148	002475	立讯精密	506	23,276.00	0.19
149	300274	阳光电源	200	23,012.00	0.19
150	600029	南方航空	3,800	22,876.00	0.19
151	605338	巴比食品	700	22,631.00	0.19
152	600012	皖通高速	3,500	22,610.00	0.19
153	002507	涪陵榨菜	600	22,596.00	0.19
154	002714	牧原股份	370	22,503.40	0.19
155	600827	百联股份	1,100	22,165.00	0.18
156	002271	东方雨虹	400	22,128.00	0.18
157	600104	上汽集团	1,000	21,970.00	0.18
158	000700	模塑科技	3,900	21,645.00	0.18
159	603087	甘李药业	200	21,316.00	0.18
160	603516	淳中科技	1,000	21,300.00	0.18
161	300408	三环集团	500	21,210.00	0.18

162	300726	宏达电子	300	21,147.00	0.18
163	601607	上海医药	1,000	21,130.00	0.18
164	300009	安科生物	1,400	20,860.00	0.17
165	600690	海尔智家	800	20,728.00	0.17
166	002274	华昌化工	2,000	20,140.00	0.17
167	600188	兖州煤业	1,300	19,968.00	0.17
168	601003	柳钢股份	3,300	19,470.00	0.16
169	601598	中国外运	3,800	19,190.00	0.16
170	600900	长江电力	900	18,576.00	0.15
171	603899	晨光文具	218	18,434.08	0.15
172	000012	南玻 A	1,800	18,432.00	0.15
173	688069	德林海	300	17,904.00	0.15
174	600782	新钢股份	3,200	17,856.00	0.15
175	000425	徐工机械	2,800	17,836.00	0.15
176	002541	鸿路钢构	300	17,505.00	0.15
177	601633	长城汽车	400	17,436.00	0.15
178	601100	恒立液压	200	17,184.00	0.14
179	600588	用友网络	500	16,630.00	0.14
180	600642	申能股份	2,600	15,964.00	0.13
181	000786	北新建材	400	15,700.00	0.13
182	300601	康泰生物	100	14,900.00	0.12
183	002587	奥拓电子	3,000	14,730.00	0.12
184	601166	兴业银行	700	14,385.00	0.12
185	000921	海信家电	1,000	14,370.00	0.12
186	002064	华峰化学	1,000	14,200.00	0.12
187	002352	顺丰控股	200	13,540.00	0.11
188	000898	鞍钢股份	2,900	12,905.00	0.11
189	600885	宏发股份	200	12,540.00	0.10
190	600795	国电电力	5,100	12,393.00	0.10
191	603885	吉祥航空	800	12,208.00	0.10
192	300756	金马游乐	400	12,180.00	0.10

193	002340	格林美	1,300	12,155.00	0.10
194	002078	太阳纸业	900	12,015.00	0.10
195	603528	多伦科技	1,400	11,970.00	0.10
196	600258	首旅酒店	500	11,930.00	0.10
197	688011	新光光电	300	11,850.00	0.10
198	000686	东北证券	1,400	11,830.00	0.10
199	000683	远兴能源	2,500	11,675.00	0.10
200	002925	盈趣科技	300	11,673.00	0.10
201	600808	马钢股份	2,700	11,583.00	0.10
202	600089	特变电工	900	11,565.00	0.10
203	600754	锦江酒店	200	11,390.00	0.09
204	600603	广汇物流	2,800	11,312.00	0.09
205	600329	中新药业	400	11,236.00	0.09
206	601668	中国建筑	2,400	11,160.00	0.09
207	601088	中国神华	508	9,916.16	0.08
208	600048	保利地产	800	9,632.00	0.08
209	002402	和而泰	400	9,588.00	0.08
210	601168	西部矿业	800	9,544.00	0.08
211	688002	睿创微纳	93	9,284.19	0.08
212	688388	嘉元科技	100	9,096.00	0.08
213	300433	蓝思科技	300	8,823.00	0.07
214	002127	南极电商	900	8,793.00	0.07
215	600323	瀚蓝环境	400	8,716.00	0.07
216	002042	华孚时尚	1,800	8,694.00	0.07
217	600438	通威股份	200	8,654.00	0.07
218	002979	雷赛智能	300	8,601.00	0.07
219	600138	中青旅	800	8,400.00	0.07
220	300628	亿联网络	100	8,380.00	0.07
221	000708	中信特钢	400	8,336.00	0.07
222	600216	浙江医药	500	8,005.00	0.07
223	300206	理邦仪器	500	7,950.00	0.07

224	601688	华泰证券	500	7,900.00	0.07
225	601899	紫金矿业	800	7,752.00	0.06
226	000800	一汽解放	700	7,574.00	0.06
227	600030	中信证券	300	7,482.00	0.06
228	603005	晶方科技	120	7,107.60	0.06
229	600873	梅花生物	1,200	6,720.00	0.06
230	600663	陆家嘴	500	6,660.00	0.06
231	300012	华测检测	200	6,376.00	0.05
232	600845	宝信软件	124	6,311.60	0.05
233	601988	中国银行	1,900	5,852.00	0.05
234	600293	三峡新材	1,800	5,274.00	0.04
235	002080	中材科技	200	5,234.00	0.04
236	688189	南新制药	100	4,630.00	0.04
237	603198	迎驾贡酒	100	4,430.00	0.04
238	300502	新易盛	140	4,375.00	0.04
239	002138	顺络电子	100	3,877.00	0.03
240	300623	捷捷微电	100	3,783.00	0.03
241	601689	拓普集团	100	3,743.00	0.03
242	300144	宋城演艺	200	3,360.00	0.03
243	600256	广汇能源	1,000	3,330.00	0.03
244	000063	中兴通讯	100	3,323.00	0.03
245	600803	新奥股份	200	3,302.00	0.03
246	603997	继峰股份	400	3,288.00	0.03
247	600755	厦门国贸	400	3,284.00	0.03
248	002249	大洋电机	600	3,150.00	0.03
249	002028	思源电气	100	3,079.00	0.03
250	000785	居然之家	500	3,035.00	0.03
251	688093	世华科技	76	3,021.76	0.03
252	600535	天士力	200	2,962.00	0.02
253	000885	城发环境	300	2,868.00	0.02
254	603156	养元饮品	100	2,858.00	0.02

255	600717	天津港	720	2,822.40	0.02
256	600376	首开股份	500	2,800.00	0.02
257	600732	爱旭股份	200	2,784.00	0.02
258	600667	太极实业	300	2,730.00	0.02
259	603218	日月股份	100	2,708.00	0.02
260	603077	和邦生物	1,300	2,704.00	0.02
261	600339	中油工程	900	2,556.00	0.02
262	000987	越秀金控	200	2,532.00	0.02
263	002266	浙富控股	500	2,495.00	0.02
264	600170	上海建工	900	2,484.00	0.02
265	300145	中金环境	800	2,432.00	0.02
266	600528	中铁工业	300	2,430.00	0.02
267	002429	兆驰股份	400	2,428.00	0.02
268	600661	昂立教育	200	2,426.00	0.02
269	601288	农业银行	800	2,424.00	0.02
270	300058	蓝色光标	400	2,420.00	0.02
271	002563	森马服饰	200	2,390.00	0.02
272	601801	皖新传媒	500	2,360.00	0.02
273	002131	利欧股份	1,000	2,340.00	0.02
273	000501	鄂武商 A	200	2,340.00	0.02
275	000883	湖北能源	500	2,295.00	0.02
276	600765	中航重机	100	2,265.00	0.02
277	002589	瑞康医药	500	2,215.00	0.02
278	688081	兴图新科	63	2,184.21	0.02
279	601928	凤凰传媒	300	2,142.00	0.02
280	601816	京沪高铁	400	2,116.00	0.02
281	002607	中公教育	100	2,089.00	0.02
282	600143	金发科技	100	2,086.00	0.02
283	603363	傲农生物	200	2,060.00	0.02
284	000402	金融街	300	2,025.00	0.02
285	000709	河钢股份	800	1,968.00	0.02

286	002002	鸿达兴业	500	1,965.00	0.02
287	000778	新兴铸管	500	1,860.00	0.02
288	600023	浙能电力	500	1,835.00	0.02
289	000930	中粮科技	200	1,802.00	0.01
290	002440	闰土股份	200	1,770.00	0.01
291	600908	无锡银行	300	1,740.00	0.01
292	000716	黑芝麻	500	1,655.00	0.01
293	000488	晨鸣纸业	200	1,628.00	0.01
294	000960	锡业股份	100	1,603.00	0.01
295	002302	西部建设	200	1,580.00	0.01
296	000825	太钢不锈	200	1,498.00	0.01
297	601997	贵阳银行	200	1,432.00	0.01
298	600266	城建发展	300	1,422.00	0.01
299	600919	江苏银行	200	1,420.00	0.01
300	000877	天山股份	100	1,303.00	0.01
301	601916	浙商银行	300	1,191.00	0.01
302	600095	湘财股份	100	1,171.00	0.01
303	600875	东方电气	100	1,097.00	0.01
304	600155	华创阳安	100	1,070.00	0.01
305	600958	东方证券	100	999.00	0.01
306	688588	凌志软件	53	960.89	0.01
307	601229	上海银行	100	820.00	0.01
308	688021	奥福环保	18	805.68	0.01
309	688300	联瑞新材	8	496.00	0.00
310	000750	国海证券	100	424.00	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	600519	贵州茅台	663,105.00	2.45
2	002139	拓邦股份	627,790.00	2.32
3	603345	安井食品	619,804.00	2.29
4	300677	英科医疗	572,464.00	2.12
5	603882	金域医学	522,745.00	1.93
6	002568	百润股份	516,372.00	1.91
7	300740	水羊股份	501,044.00	1.85
8	600887	伊利股份	495,205.00	1.83
9	600309	万华化学	487,135.00	1.80
10	603806	福斯特	447,594.00	1.66
11	002271	东方雨虹	441,859.00	1.63
12	300146	汤臣倍健	439,374.54	1.63
13	603856	东宏股份	414,644.00	1.53
14	002572	索菲亚	405,474.00	1.50
15	300724	捷佳伟创	398,838.00	1.48
16	002064	华峰化学	393,399.00	1.46
17	002179	中航光电	389,580.00	1.44
18	002705	新宝股份	388,461.00	1.44
19	603678	火炬电子	359,135.00	1.33
20	600060	海信视像	348,101.00	1.29

注：“买入金额”按买入成交金额（成交价乘以成交数量）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	603345	安井食品	803,162.00	2.97
2	300896	爱美客	802,600.60	2.97
3	002139	拓邦股份	800,022.00	2.96
4	600309	万华化学	698,703.00	2.59
5	300124	汇川技术	665,078.76	2.46

6	603501	韦尔股份	657,955.00	2.43
7	600519	贵州茅台	651,388.00	2.41
8	002568	百润股份	649,201.00	2.40
9	300677	英科医疗	645,439.00	2.39
10	000661	长春高新	596,005.00	2.21
11	300146	汤臣倍健	584,080.20	2.16
12	603882	金域医学	530,110.00	1.96
13	002415	海康威视	521,217.00	1.93
14	002027	分众传媒	519,914.00	1.92
15	603317	天味食品	508,280.00	1.88
16	601799	星宇股份	492,975.00	1.82
17	300408	三环集团	479,428.00	1.77
18	601899	紫金矿业	469,701.00	1.74
19	002236	大华股份	454,565.32	1.68
20	603486	科沃斯	452,733.00	1.68

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	68,432,656.03
卖出股票收入（成交）总额	84,395,569.31

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)	1,463.60	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,463.60	0.01

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	123111	东财转3	10	1,463.60	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

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通策医疗（证券代码：600763.SH）因未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责，收到上海证券交易所监管关注。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	7,742.30
2	应收证券清算款	95,784.51
3	应收股利	-
4	应收利息	115.71
5	应收申购款	99.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,742.39

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无前十名股票中存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
493	13,154.65	0.00	0.00%	6,485,240.55	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	596,974.07	9.2051%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
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(2018年09月17日)基金份额总额	400,366,734.00
本报告期期初基金份额总额	15,823,095.67
本报告期基金总申购份额	1,215,227.92
减：本报告期基金总赎回份额	10,553,083.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,485,240.55

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、基金管理人于2021年8月6日聘任吴林惠先生担任公司第四届董事会董事职务，原董事夏理芬先生于2021年8月6日离任；

2、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。

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	529,793.00	0.35%	376.81	0.34%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	21,771,741.58	14.25%	15,940.69	14.36%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江	2	95,931.00	0.06%	70.14	0.06%	-

证券						
东北证券	2	453,511.00	0.30%	331.63	0.30%	-
东方财富证券股份有限公司	2	22,371,342.26	14.64%	16,360.18	14.74%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	49,809,744.81	32.61%	35,801.29	32.26%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	2,812,236.20	1.84%	2,056.71	1.85%	-
国泰君安	2	439,299.00	0.29%	321.24	0.29%	-
国信证券	2	11,537,348.36	7.55%	8,206.58	7.39%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	277,596.00	0.18%	197.46	0.18%	-

华融 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
西南 证券	2	-	-	-	-	-
湘财 证券	2	3,022,491.32	1.98%	2,814.74	2.54%	-
信达 证券	2	-	-	-	-	-
银河 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	766,170.69	0.50%	713.46	0.64%	-
中国 中投	2	-	-	-	-	-

证券						
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	32,035,798.18	20.97%	22,787.19	20.53%	-
中信建投证券	2	842,008.07	0.55%	615.69	0.55%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	4	5,998,427.29	3.93%	4,386.95	3.95%	-

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

本报告期内无基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	《财通量化核心优选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	2021-01-21
2	《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	2021-01-26
3	《财通量化核心优选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	2021-03-27
4	《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	2021-04-02
5	《财通基金管理有限公司关于旗下部分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	2021-04-10
6	《财通量化核心优选混合优选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	2021-04-21
7	《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	2021-05-12
8	《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	2021-05-14
9	《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	2021-06-18
10	《财通基金管理有限公司关于根	中国证监会指定报刊	2021-06-26

	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》	及网站	
11	《财通量化核心优选混合优选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	2021-06-26
12	《财通量化核心优选混合优选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	2021-06-26
13	《财通量化核心优选混合优选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	2021-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2021-01-07 至 2021-01-28	2,864,428.15	0.00	2,864,428.15	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金采用量化模型构建投资组合，量化模型仅是选股模型，不是交易模型。在实际运作过程中，量化模型有失效的可能。本基金可以投资科创板股票，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。本基金为混合型基金，预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金的投资范围包括存托凭证，面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。</p> <p>在报告期内，本基金单一投资者持有的基金份额已超过20%，可能对基金运作造成如下风险：</p>							

(1)赎回申请延缓支付的风险

该等投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付赎回款项的风险。

(2)基金净值大幅波动的风险

该等投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；

(3)基金规模过小导致的风险

该等投资者赎回后，很可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。

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、财通量化核心优选混合型证券投资基金合同；
- 3、财通量化核心优选混合型证券投资基金托管协议；
- 4、财通量化核心优选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

上海市浦东新区银城中路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
二〇二一年八月二十八日