

财通安盈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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57

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 .....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
7.12 投资组合报告附注 .....	58
§8 基金份额持有人信息 .....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
§9 开放式基金份额变动 .....	60
§10 重大事件揭示 .....	61
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
10.8 其他重大事件 .....	62
§11 备查文件目录 .....	63
11.1 备查文件目录 .....	63
11.2 存放地点 .....	64
11.3 查阅方式 .....	64

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通安盈混合型证券投资基金	
基金简称	财通安盈混合	
场内简称	-	
基金主代码	010636	
交易代码	-	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2020年11月25日	
基金管理人	财通基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	517,123,354.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通安盈混合A	财通安盈混合C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	010636	010637
报告期末下属分级基金的份额总额	261,093,898.54份	256,029,455.46份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的稳健回报。
投资策略	<p>本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整,以规避或分散市场风险,力争实现基金资产的中长期稳健增值。</p> <p>债券投资策略上,本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。本基金注重组合的流动性,在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利</p>

	<p>差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，自上而下确定大类债券资产配置和信用债券类属配置，动态调整组合久期和信用债券的结构，依然坚持自下而上精选个券的策略，在获取持有期收益的基础上，优化组合的流动性。</p> <p>在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。本基金的股票投资将在行业研究的基础上，通过自上而下和自下而上相结合的方法，在充分研究公司商业模式、竞争优势、公司成长空间、行业竞争格局的背景下，选择在行业中具备竞争优势、成长性良好和估值合理的股票。</p> <p>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。</p> <p>资产支持证券投资策略上，本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率*15%+恒生指数收益率*5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。</p>

### 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		兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武伟	林兴盛
	联系电话	021-20537888	021-52629999-213707
	电子邮箱	service@ctfund.com	linxingsheng@cib.com.cn
客户服务电话	400-820-9888		95561
传真	021-20537999		021-62159217
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号505室		福州市湖东路154号
办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼		上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码	200120		200120
法定代表人	夏理芬		吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
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)	
	财通安盈混合A	财通安盈混合C

本期已实现收益	8,446,580.21	7,543,655.41
本期利润	13,366,236.30	10,030,069.70
加权平均基金份额本期利润	0.0519	0.0437
本期加权平均净值利润率	5.02%	4.22%
本期基金份额净值增长率	5.44%	5.28%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2021年06月30日)	
期末可供分配利润	8,460,605.11	7,811,924.77
期末可供分配基金份额利润	0.0324	0.0305
期末基金资产净值	273,957,497.99	268,159,586.80
期末基金份额净值	1.0493	1.0474
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.93%	4.74%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

财通安盈混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.61%	0.24%	-0.31%	0.15%	-0.30%	0.09%
过去三个月	2.20%	0.28%	0.92%	0.18%	1.28%	0.10%



过去六个月	5.44%	0.41%	0.95%	0.24%	4.49%	0.17%
自基金合同生效起至今	4.93%	0.38%	2.38%	0.23%	2.55%	0.15%

财通安盈混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.63%	0.24%	-0.31%	0.15%	-0.32%	0.09%
过去三个月	2.13%	0.28%	0.92%	0.18%	1.21%	0.10%
过去六个月	5.28%	0.41%	0.95%	0.24%	4.33%	0.17%
自基金合同生效起至今	4.74%	0.38%	2.38%	0.23%	2.36%	0.15%

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 2020 年 11 月 25 日，基金合同生效起至披露时点不满一年。  
(2)本基金建仓期为基金合同生效起 6 个月，截至建仓期末和本报告期末,基金的资产配置将在建仓期末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		
杨焯超	本基金的 基金经理	2020-11-25	-	10年	复旦大学世界经济本硕。2010年7月至2018年6月就职于光大保德信基金管理有限公司，历任市场部产品助理、产品经理、固定收益部研究员、基金经理。2018年7月加入财通基金管理有限公司，曾担任固定收益部投资经理，现任固定收益部基金经理。
沈犁	本基金的 基金经理 助理	2020-11-25	-	7年	上海交通大学高级金融学院金融工商管理硕士MBA、文学学士。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员、中国国际金融股份有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司高级研究员，惠理集团高级分析员。2020年8月加入财通基金管理有限公司，担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。

## 4.2 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。

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

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年一季度债市整体震荡，相对去年末，利率多有所上行，并且短端上行幅度更大，利率曲线平坦化。

1月下半月开始狭义流动性由松转紧，去年末以来股债齐涨的势头阶段性放缓。而股市整体特别是部分抱团板块的估值已不算便宜，债市收益率在上半月央行流动性呵护的背景下也位于较低水平，资金在寻找港股等估值洼地。2月股、债、商品等的波动明显加大，疫情好转、经济修复、政策常态回归下流动性与基本面预期相互对抗是可能的原因。通胀预期下以美债收益率为代表的无风险利率波动给各类资产都带来扰动。对股市而言，流动性预期不稳，估值消化、收敛的过程比预想的幅度更大。3月之后债券市场进入低波动状态，货币政策缺少空间、基本面预期一致是核心原因。低波动不可能是常态，后续仍关注推动市场变盘的力量，经济增速环比是关键，而供给、政策、通胀和海外等扰动因素值得关注。

一季度债券市场在基本面一致预期下，波动主要来源于资金利率的走势。资金利率中枢一季度逐级下行，但目前3个月shibor已下行至今年以来低位，而且一季度货币政策例会多延续此前货币政策执行报告和政府工作报告的相关说法，对经济形势的判断也日趋乐观，但对于后续政策方向的启示不多，尤其去掉“不急转弯”所反映的政策含义并不明确。

二季度债市走出了慢牛行情。10年国债收益率从3.19%下行至3.07%，10年国开收益率从3.57%下行至3.48%，国债和国开分别下行12bp和8bp，季内利率波动不大，平稳下行。基本面角度看，国内经济持续复苏，但由于去年基数原因，表观增速呈现冲高回落态势。最新数据显示，生产端工业增加值同比小幅回落，表现较为平稳。需求端出口有所回落，地产投资维持高位，制造业投资延续改善。整体二季度经济动能强于一季度，生产保持平稳，消费持续恢复，出口、制造业投资及地产投资对经济存在一定的支撑。货币政策方面，上半年货币政策始终保持正常化，维持银行间流动性平衡，资金面利率整体在上半年呈现逐步下行态势，除在传统季末时点有所波动外，整体平稳运行。由于国内经济内生增长动力仍有待明确，结构性政策十分必要，因此宽松政策很难完全退出。

操作方面，本基金在本报告期较为积极地参与权益市场，在行业配置上相对均衡，债券方面保持中短久期，获取稳定票息回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通安盈混合A基金份额净值为1.0493元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.44%，同期业绩比较基准收益率为0.95%；截至报告期末财通安盈混合C基金份额净值为1.0474元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.28%，同期业绩比较基准收益率为0.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，预计出口和地产存在高位回落的压力，但经济回落斜率较缓，财政节奏后移将对经济带来一定的支撑。但是在下半年通胀可能成为市场的焦点关注，当前资本市场主要沿着经济下行和货币宽松的逻辑运行，但下半年若海外市场持续复苏，市场逻辑或将发生一定变化。随着通胀高企、经济的持续恢复以及疫苗接种加速，后续货币政策或将边际发生变化。此外，下半年起有大量MLF到期，央行操作比去年下半年更加宽松可能性不大；而且下半年海外货币政策或开启整体转向，资金面上的压力预期也会略大于上半年。债市震荡格局不改，全年出现大牛或者大熊的可能性都不大。对债券市场来说，保持中等久期，获取稳定票息回报的策略将更为占优。权益方面，目前风险偏好处在较高位置，未来1-2个季度整体市场仍可能保持一定动能，但需要关注可能出现的市场波动，重点关注周期、科技、新能源等板块，增厚组合收益。

#### 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》，截至报告期末，基金管理人未对旗下公开募集证券投资基金及特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

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），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》，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。

#### 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

**5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

**§6 中期财务会计报告(未经审计)****6.1 资产负债表**

会计主体：财通安盈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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,224,269.38	891,036.46
结算备付金		79,569.94	530,739.03
存出保证金		56,303.89	18,690.10
交易性金融资产	6.4.7.2	531,492,123.25	364,366,077.18
其中：股票投资		142,267,412.85	127,020,077.18
基金投资		-	-
债券投资		389,224,710.40	237,346,000.00
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款		-	13,005,727.12
应收利息	6.4.7.5	4,802,030.74	4,211,749.72
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-



资产总计		542,654,297.20	403,024,019.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		267,398.67	188,791.28
应付托管费		44,566.45	31,465.19
应付销售服务费		66,139.00	34,632.62
应付交易费用	6.4.7.7	49,719.39	104,125.30
应交税费		20,128.75	2,844.67
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,260.15	30,000.00
负债合计		537,212.41	391,859.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	517,123,354.00	404,615,381.03
未分配利润	6.4.7.10	24,993,730.79	-1,983,220.48
所有者权益合计		542,117,084.79	402,632,160.55
负债和所有者权益总计		542,654,297.20	403,024,019.61

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1.0483元，基金份额总额517,123,354.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通安盈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
<b>一、收入</b>		25,913,596.36
1.利息收入		5,198,377.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	83,609.02
债券利息收入		5,026,099.60
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		88,669.03
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,085,626.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,659,713.24
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-299,463.14
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-
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	725,376.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,406,070.38
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	223,521.57
<b>减：二、费用</b>		2,517,290.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,506,542.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	251,090.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	354,474.02
4. 交易费用	6.4.7.20	253,900.47
5. 利息支出		31,905.97
其中：卖出回购金融资产支出		31,905.97
6. 税金及附加		13,207.65
7. 其他费用	6.4.7.21	106,169.05

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		23,396,306.00
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		23,396,306.00

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：财通安盈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)	404,615,381.03	-1,983,220.48	402,632,160.55
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	23,396,306.00	23,396,306.00
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)	112,507,972.97	3,580,645.27	116,088,618.24
其中：1.基金申购款	176,613,311.88	5,217,250.59	181,830,562.47
2.基金赎回 款	-64,105,338.91	-1,636,605.32	-65,741,944.23
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)	517,123,354.00	24,993,730.79	542,117,084.79

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

财通安盈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〔2020〕2846号文《关于准予财通安盈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于2020年11月17日至2020年11月23日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2020)验字第60951782\_B29号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2020年11月25日生效。本基金为契约型，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币207,997,735.44元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币0.48元，以上实收基金（本息）合计为人民币207,997,735.92元，折合207,997,735.92份基金份额。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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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（包括主板、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）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、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、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、货币市场工具、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金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-50%（其中投资于港股通标的股票投资占股票资产的比例为0%-50%）；本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的20%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。

中债综合指数收益率×80%+沪深300指数收益率\*15% +恒生指数收益率\*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2021年上半年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

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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2021年1月1日至2021年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

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

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：贷款和应收款项及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金以持有至到期为目的的债券投资分类为持有至到期投资，在财务报表中以“其他资产”列示。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且管理层有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

## (2)金融负债分类

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

对于取得债券投资支付的价款中包含债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。持有至到期投资、贷款和应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，其摊销或减值产生的利得或损失，计入当期损益；

对于贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，计入当期损益；当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (2) 回购协议

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

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

表明金融资产发生减值的客观证据，是指金融资产初始确认后实际发生的、对该金融资产的预计未来现金流量有影响，且本基金能够对该影响进行可靠计量的事项。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3)资产支持证券利息收入按实际持有期内逐日计提。资产支持证券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

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

(5)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

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

(7)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数不超过12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。



## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 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，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	6,224,269.38
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	6,224,269.38

注：本基金本报告期末未投资于定期存款。

### 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	136,564,692.11	142,267,412.85	5,702,720.74	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	116,201,928.79	116,889,710.40	687,781.61
	银行间市场	271,745,243.28	272,335,000.00	589,756.72
	合计	387,947,172.07	389,224,710.40	1,277,538.33
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	524,511,864.18	531,492,123.25	6,980,259.07	

### 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

本基金本年度末及上年度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

本基金本报告期末及上年度末均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	2,025.07
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	35.80
应收债券利息	4,799,944.57
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	25.30
合计	4,802,030.74

注：其他为结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	47,644.39

银行间市场应付交易费用	2,075.00
合计	49,719.39

#### 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	-
预提费用	89,260.15
合计	89,260.15

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 财通安盈混合A

金额单位：人民币元

项目 (财通安盈混合A)	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	249,560,954.38	249,560,954.38
本期申购	69,638,279.07	69,638,279.07
本期赎回（以“-”号填列）	-58,105,334.91	-58,105,334.91
本期末	261,093,898.54	261,093,898.54

##### 6.4.7.9.2 财通安盈混合C

金额单位：人民币元

项目 (财通安盈混合C)	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	155,054,426.65	155,054,426.65
本期申购	106,975,032.81	106,975,032.81
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,004.00	-6,000,004.00
本期末	256,029,455.46	256,029,455.46

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 财通安盈混合A

单位：人民币元

项目 (财通安盈混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,097.75	-1,244,611.80	-1,194,514.05
本期利润	8,446,580.21	4,919,656.09	13,366,236.30
本期基金份额交易产生的变动数	-36,072.85	727,950.05	691,877.20
其中：基金申购款	267,818.36	1,924,464.04	2,192,282.40
基金赎回款	-303,891.21	-1,196,513.99	-1,500,405.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,460,605.11	4,402,994.34	12,863,599.45

#### 6.4.7.10.2 财通安盈混合C

单位：人民币元

项目 (财通安盈混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,253.56	-773,452.87	-788,706.43
本期利润	7,543,655.41	2,486,414.29	10,030,069.70
本期基金份额交易产生的变动数	283,522.92	2,605,245.15	2,888,768.07
其中：基金申购款	276,420.65	2,748,547.54	3,024,968.19
基金赎回款	7,102.27	-143,302.39	-136,200.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,811,924.77	4,318,206.57	12,130,131.34

#### 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	67,614.56
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	7,733.65

其他	8,260.81
合计	83,609.02

注：本基金本期末其他利息收入包括结算保证金利息收入和应收申购款利息收入，分别为460.87元和7799.94元。

#### 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	87,175,940.49
减：卖出股票成本总额	74,516,227.25
买卖股票差价收入	12,659,713.24

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期末未有基金投资收益。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-299,463.14
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	-299,463.14

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑	1,018,104,355.25

付) 成交总额	
减: 卖出债券 (、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	1,008,663,604.75
减: 应收利息总额	9,740,213.64
买卖债券差价收入	-299,463.14

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未投资资产支持证券，资产支持证券收益为零。

#### 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

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

##### 6.4.7.16.2 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。



#### 6.4.7.17 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	725,376.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	725,376.66

#### 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	7,406,070.38
——股票投资	6,632,673.71
——债券投资	773,396.67
——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	7,406,070.38

#### 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	28,453.36

转换费收入	195,068.21
合计	223,521.57

#### 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	237,002.97
银行间市场交易费用	16,897.50
合计	253,900.47

#### 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	7,608.90
帐户维护费	9,000.00
其他费用	300.00
合计	106,169.05

### 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06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	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券票交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期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

基金本报告期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
当期发生的基金应支付的管理费	1,506,542.71
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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0.6%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×0.6% / 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
	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	251,090.49

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0.10%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×0.10%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通安盈混合A	财通安盈混合C	合计
财通证券	0.00	0.00	0.00
财通基金	0.00	354,469.21	354,469.21
兴业银行	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	354,469.21	354,469.21

### 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

本基金本报告期末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

财通安盈混合A

份额单位：份

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金合同生效日（2020年11月25日）持有的基金份额	30,000,000.00
报告期初持有的基金份额	0.00

报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	30,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.49%

财通安盈混合C

份额单位：份

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金合同生效日（2020年11月25日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

**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**

本基金本报告期末基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**6.4.10.5 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	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	6,224,269.38	67,614.56

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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

本基金本报告期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——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688696	极米科技	2021-02-23	2021-09-03	新股限售	133.73	780.24	894	119,554.62	697,534.56	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	349	16,518.17	87,934.04	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	认购新发证券	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688314	康拓医疗	2021-05-11	2021-01-18	新股限售	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-00-08	新股限售	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
6881	联测	2021-0	2021-1	新股限售	19.1	49.2	1,415	27,08	69,74	-

13	科技	4-26	1-08	售	4	9		3.10	5.35	
3010 18	申菱 环境	2021-0 6-28	2021-0 7-07	认购新 发证券	8.29	8.29	7,029	58,27 0.41	58,27 0.41	-
3010 18	申菱 环境	2021-0 6-28	2022-0 1-07	新股限 售	8.29	8.29	782	6,482. 78	6,482. 78	-
6882 17	睿昂 基因	2021-0 5-07	2021-1 1-17	新股限 售	18.4 2	58.4 0	1,040	19,15 6.80	60,73 6.00	-
3009 79	华利 集团	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股限 售	33.2 2	87.5 0	634	21,06 1.48	55,47 5.00	-
6880 87	英科 再生	2021-0 6-30	2021-0 7-09	认购新 发证券	21.9 6	21.9 6	2,469	54,21 9.24	54,21 9.24	-
3010 17	漱玉 平民	2021-0 6-23	2021-0 7-05	认购新 发证券	8.86	8.86	4,995	44,25 5.70	44,25 5.70	-
3010 17	漱玉 平民	2021-0 6-23	2022-0 1-05	新股限 售	8.86	8.86	555	4,917. 30	4,917. 30	-
3010 20	密封 科技	2021-0 6-28	2021-0 7-06	认购新 发证券	10.6 4	10.6 4	3,789	40,31 4.96	40,31 4.96	-
3010 20	密封 科技	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股限 售	10.6 4	10.6 4	421	4,479. 44	4,479. 44	-
3009 81	中红 医疗	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股限 售	48.5 9	90.3 9	352	17,10 3.68	31,81 7.28	-
3010 21	英诺 激光	2021-0 6-28	2021-0 7-06	认购新 发证券	9.46	9.46	2,609	24,68 1.14	24,68 1.14	-
3010 21	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股限 售	9.46	9.46	290	2,743. 40	2,743. 40	-
3009 53	震裕 科技	2021-0 3-11	2021-0 9-22	新股限 售	28.7 7	99.8 5	240	6,904. 80	23,96 4.00	-
3010 09	可靠 股份	2021-0 6-08	2021-1 2-17	新股限 售	12.5 4	27.8 9	801	10,04 4.54	22,33 9.89	-
3009 41	创识 科技	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股限 售	21.3 1	49.9 4	399	8,502. 69	19,92 6.06	-
3010 15	百洋 医药	2021-0 6-22	2021-1 2-30	新股限 售	7.64	38.8 3	462	3,529. 68	17,93 9.46	-

688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	认购新发证券	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股限售	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股限售	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股限售	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股限售	8.67	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
3009	冠中	2021-0	2021-0	新股限售	-	27.4	108	-	2,961.	-



48	生态	6-04	8-25	售-送股		2			36	
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股限售	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-

300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

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

#### 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停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，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

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

#### 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兴业银行股份有限公司，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于约定开放日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。

本基金采用定期开放的运作方式，在封闭期内不办理申购与赎回业务。针对定期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。

#### 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	6,224,269.38	-	-	-	-	-	6,224,269.38
结算备付金	79,569.94	-	-	-	-	-	79,569.94
存出	56,303.89	-	-	-	-	-	56,303.89

保证金							
交易性金融资产	28,000,000.00	19,866,000.00	60,338,000.00	280,559,605.00	461,105.40	142,267,412.85	531,492,123.25
应收利息	-	-	-	-	-	4,802,030.74	4,802,030.74
资产总计	34,360,143.21	19,866,000.00	60,338,000.00	280,559,605.00	461,105.40	147,069,443.59	542,654,297.20
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	267,398.67	267,398.67
应付托管费	-	-	-	-	-	44,566.45	44,566.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-	66,139.00	66,139.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	49,719.39	49,719.39
应交税费	-	-	-	-	-	20,128.75	20,128.75
其他负债	-	-	-	-	-	89,260.15	89,260.15
负债总计	-	-	-	-	-	537,212.41	537,212.41
利率敏感度缺口	34,360,143.21	19,866,000.00	60,338,000.00	280,559,605.00	461,105.40	146,532,231.18	542,117,084.79
上年度末 2020 年 12 月 31	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

日							
资产							
银行存款	891,036.46	-	-	-	-	-	891,036.46
结算备付金	530,739.03	-	-	-	-	-	530,739.03
存出保证金	18,690.10	-	-	-	-	-	18,690.10
交易性金融资产	-	30,027,000.00	-	207,319,000.00	-	127,020,077.18	364,366,077.18
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,005,727.12	13,005,727.12
应收利息	-	-	-	-	-	4,211,749.72	4,211,749.72
资产总计	21,440,465.59	30,027,000.00	-	207,319,000.00	-	144,237,554.02	403,024,019.61
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	188,791.28	188,791.28
应付托管费	-	-	-	-	-	31,465.19	31,465.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,632.62	34,632.62
应付交易	-	-	-	-	-	104,125.30	104,125.30

费用							
应交税费	-	-	-	-	-	2,844.67	2,844.67
其他负债	-	-	-	-	-	30,000.00	30,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	391,859.06	391,859.06
利率敏感度缺口	21,440,46 5.59	30,027,00 0.00	-	207,319,00 0.00	-	143,845,69 4.96	402,632,16 0.55

注：(1)本基金于2020年11月25日成立，无比较式的上年度数据。

(2)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

假设	1.市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响，对其他会计科目的影响可忽略。		
假设	2.基金组合对利率的风险暴露，根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到，债券凸性对组合净值的影响可忽略。		
假设	3.市场即期利率曲线平行变动。		
假设	4.基金组合构成和其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,252,305.55	-
	市场利率上升25个基点	-1,252,305.55	-

注：本基金2020年11月25日成立，上期末处于建仓期，未对利率敏感性进行分析。

#### 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，通过对股票和债券等金融资产进行积极配置，并精选优质个股和券种，从而在保障基金资产流动性和安全性的前提下，谋求超越比较基准的投资回报，力求实现基金资产的长期稳定增值。本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为0% - 50%（其中投资于港股通标的股票投资占股票资产的比例为0%-50%）。开放期内，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	142,267,412.85	26.24	127,020,077.18	31.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	389,224,710.40	71.80	237,346,000.00	58.95



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	531,492,123.25	98.04	364,366,077.18	90.50

注：本基金于2020年11月25日成立，无比较上年数据。

#### 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%	7630287.71	-
	业绩比较基准减少1%	-7630287.71	-

注：本基金于2020年11月25日成立，无比较式的上年度数据。

#### 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06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178,998,334.99元，属于第二层次的余额为人民币350,853,030.51元，属于第三层次的余额为人民币1,640,757.75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132,050,077.18元，属于第二层次的余额为人民币232,316,000.00元，属于第三层次的余额为人民币0元）。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

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

(3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

单位：人民币元

交易性金融资产

上年度末 0

转入第三层次 -

转出第三层次 -

当期计入损益的利得或损失总额 1,110,692.63

购买 530,065.12

出售 -

本期末 1,640,757.75

本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动 972,401.61

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	142,267,412.85	26.22
	其中：股票	142,267,412.85	26.22
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	389,224,710.40	71.73
	其中：债券	389,224,710.40	71.73
	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	6,303,839.32	1.16
8	其他各项资产	4,858,334.63	0.90
9	合计	542,654,297.20	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,381,366.21	10.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	315,648.66	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	4,217,710.00	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,333.89	0.01
J	金融业	72,457,111.20	13.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,788,565.00	1.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	142,267,412.85	26.24

### 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	600036	招商银行	307,049	16,638,985.31	3.07
2	002142	宁波银行	395,307	15,405,113.79	2.84
3	000001	平安银行	563,600	12,748,632.00	2.35
4	002027	分众传媒	1,146,500	10,788,565.00	1.99
5	600519	贵州茅台	5,200	10,694,840.00	1.97
6	601601	中国太保	289,900	8,398,403.00	1.55
7	601939	建设银行	1,126,400	7,490,560.00	1.38
8	600690	海尔智家	253,700	6,573,367.00	1.21
9	601398	工商银行	1,264,000	6,534,880.00	1.21
10	601818	光大银行	1,377,200	5,205,816.00	0.96
11	000858	五粮液	14,417	4,294,680.13	0.79
12	002352	顺丰控股	62,300	4,217,710.00	0.78
13	603605	珀莱雅	21,200	4,170,252.00	0.77
14	000568	泸州老窖	17,269	4,074,447.86	0.75
15	002493	荣盛石化	193,908	3,348,791.16	0.62
16	002271	东方雨虹	53,800	2,976,216.00	0.55
17	600309	万华化学	25,103	2,731,708.46	0.50
18	000301	东方盛虹	111,700	2,334,530.00	0.43
19	600966	博汇纸业	174,400	2,275,920.00	0.42
20	002311	海大集团	25,600	2,088,960.00	0.39
21	002541	鸿路钢构	34,000	1,983,900.00	0.37

22	002078	太阳纸业	144,900	1,934,415.00	0.36
23	002791	坚朗五金	5,700	1,106,085.00	0.20
24	600150	中国船舶	58,800	970,788.00	0.18
25	688696	极米科技	894	697,534.56	0.13
26	688161	N威高	3,069	325,467.45	0.06
27	301015	N百洋	4,614	251,115.78	0.05
28	688601	力芯微	1,174	216,133.40	0.04
29	301013	C利和兴	4,704	168,966.51	0.03
30	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.03
31	301016	N雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
32	301004	C嘉益	3,115	90,654.98	0.02
33	300957	贝泰妮	349	87,934.04	0.02
34	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
35	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.01
36	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.01
37	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.01
38	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
39	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.01
40	300979	华利集团	634	55,475.00	0.01
41	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
42	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
43	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
44	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
45	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
46	300981	中红医疗	352	31,817.28	0.01
47	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
48	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
49	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
50	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
51	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
52	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00

53	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
54	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
55	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
56	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
57	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
58	603171	N税友	637	12,230.40	0.00
59	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
60	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
61	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
62	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
63	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
64	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
65	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
66	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
67	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
68	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
69	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
70	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
71	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
72	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
73	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
74	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
75	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
76	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
77	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
78	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
79	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
80	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
81	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
82	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
83	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00

84	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
85	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
86	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
87	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	002027	分众传媒	6,941,149.00	1.72
2	600519	贵州茅台	6,431,997.00	1.60
3	601601	中国太保	5,389,545.00	1.34
4	000858	五粮液	4,812,364.00	1.20
5	600036	招商银行	4,688,253.00	1.16
6	002352	顺丰控股	4,473,053.00	1.11
7	600305	恒顺醋业	3,996,454.00	0.99
8	000001	平安银行	3,995,402.00	0.99
9	603605	珀莱雅	3,574,226.00	0.89
10	600690	海尔智家	3,496,250.00	0.87
11	600966	博汇纸业	3,197,595.00	0.79
12	002078	太阳纸业	3,194,469.00	0.79
13	002311	海大集团	3,191,733.00	0.79
14	000301	东方盛虹	2,996,963.00	0.74
15	000333	美的集团	2,996,059.00	0.74
16	002271	东方雨虹	2,687,206.00	0.67
17	002493	荣盛石化	2,497,538.00	0.62
18	002541	鸿路钢构	2,496,874.00	0.62
19	000568	泸州老窖	1,479,934.00	0.37
20	600150	中国船舶	997,127.00	0.25

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	601318	中国平安	8,982,824.13	2.23
2	002311	海大集团	7,586,613.77	1.88
3	000333	美的集团	7,436,481.92	1.85
4	000301	东方盛虹	4,999,889.00	1.24
5	600048	保利地产	4,949,281.30	1.23
6	000002	万科A	4,847,875.76	1.20
7	600872	中炬高新	3,741,932.83	0.93
8	002541	鸿路钢构	3,490,803.00	0.87
9	300146	汤臣倍健	3,387,649.09	0.84
10	300363	博腾股份	3,293,553.24	0.82
11	600305	恒顺醋业	3,101,169.20	0.77
12	002821	凯莱英	3,084,114.76	0.77
13	000568	泸州老窖	3,002,667.93	0.75
14	000858	五粮液	2,881,504.18	0.72
15	600519	贵州茅台	1,780,832.00	0.44
16	002078	太阳纸业	1,338,680.00	0.33
17	002695	煌上煌	1,136,701.00	0.28
18	688131	皓元医药	656,605.00	0.16
19	300957	贝泰妮	523,879.00	0.13
20	300979	华利集团	512,910.00	0.13

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	83,130,889.21
卖出股票收入（成交）总额	87,175,940.49

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	28,000,000.00	5.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,992,000.00	7.38
	其中：政策性金融债	39,992,000.00	7.38
4	企业债券	30,273,000.00	5.58
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	202,334,000.00	37.32
7	可转债(可交换债)	38,610,710.40	7.12
8	同业存单	19,866,000.00	3.66
9	其他	30,149,000.00	5.56
10	合计	389,224,710.40	71.80

### 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	101800426	18宁波轨交MTN001	300,000	30,729,000.00	5.67
2	102100471	21苏国资MTN001	300,000	30,309,000.00	5.59
3	149265	20深铁05	300,000	30,273,000.00	5.58
4	019640	20国债10	280,000	28,000,000.00	5.16
5	132015	18中油EB	270,000	27,607,500.00	5.09

### 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

本基金本报告期内未投资贵金属。

## 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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 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合约。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名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收到公开谴责、处罚的情形。

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	56,303.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,802,030.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,858,334.63

### 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	132015	18中油EB	27,607,500.00	5.09
2	132009	17中油EB	10,542,105.00	1.94

### 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不存在流通受限的股票。

### 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

份额	持	户均持有的	持有人结构
----	---	-------	-------

级别	有人户数 (户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
财通安盈混合A	191	1,366,983.76	261,090,584.90	100.00%	3,313.64	0.00%
财通安盈混合C	69	3,710,571.82	256,029,065.44	100.00%	390.02	0.00%
合计	260	1,988,935.98	517,119,650.34	100.00%	3,703.66	0.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	财通安盈混合A	2,772.58	0.000%
	财通安盈混合C	225.03	0.000%
	合计	2,997.61	0.000%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	财通安盈混合A	0
	财通安盈混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	财通安盈混合A	0
	财通安盈混合C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通安盈混合A	财通安盈混合C
基金合同生效日(2020年11月25日)基金份额总额	154,497,342.88	53,500,393.04
本报告期期初基金份额总额	249,560,954.38	155,054,426.65
本报告期基金总申购份额	69,638,279.07	106,975,032.81
减：本报告期基金总赎回份额	58,105,334.91	6,000,004.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	261,093,898.54	256,029,455.46

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、本报告期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	
东兴证券	2	163,891,524.49	100.00%	117,932.56	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券	248,771,719.91	100.00%	423,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 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	《财通基金管理有限公司关于财通安盈混合型证券投资基金拟参与科创板投资及相关风险揭示的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-05
2	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-06
3	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购费率优惠活动	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09

	动的公告》		
4	《财通安盈混合型证券投资基金暂停大额申购（转换转入）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10
5	《财通安盈混合型证券投资基金恢复大额申购（转换转入）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-07
6	《财通安盈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	《财通安盈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

## 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、财通安盈混合型证券投资基金基金合同；
- 3、财通安盈混合型证券投资基金托管协议；
- 4、财通安盈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