

# 财通资管价值发现混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
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	58
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	58
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	58
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 本基金投资股指期货的投资政策	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	60
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 .....	61
§9 开放式基金份额变动 .....	61
§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 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
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 .....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
§12 备查文件目录 .....	64
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	65
12.3 查阅方式 .....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管价值发现混合型证券投资基金	
基金简称	财通资管价值发现混合	
基金主代码	008276	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年03月23日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	887,866,144.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通资管价值发现混合A	财通资管价值发现混合C
下属分级基金的交易代码	008276	012767
报告期末下属分级基金的份额总额	657,352,614.57份	230,513,529.86份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、金融衍生产品投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	财通证券资产管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	刘泉	秦一楠
	联系电话	021-20568203	010-66060069
	电子邮箱	lq@ctzg.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95336	95599
传真		021-68753502	010-68121816
注册地址		浙江省杭州市上城区白云路2 6号143室	北京市东城区建国门内大街6 9号
办公地址		上海市浦东新区栖霞路26弄 富汇大厦B座8、9层	北京市西城区复兴门内大街2 8号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200122	100031
法定代表人		马晓立	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通证券资产管理有限公司	浙江省杭州市上城区新业路中国人 寿大厦2幢22层

## §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 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	财通资管价值发现	财通资管价值发现

	混合A	混合C
本期已实现收益	15,769,750.89	6,767,699.29
本期利润	7,589,978.29	-19,209,230.47
加权平均基金份额本期利润	0.0110	-0.0861
本期加权平均净值利润率	0.59%	-4.61%
本期基金份额净值增长率	1.56%	1.37%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	377,186,884.54	177,602,385.66
期末可供分配基金份额利润	0.5738	0.7705
期末基金资产净值	1,172,217,634.46	408,115,915.52
期末基金份额净值	1.7832	1.7705
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	78.32%	-14.93%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

财通资管价值发现混合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	0.97%	1.29%	0.88%	0.61%	0.09%	0.68%
过去三个月	-11.28%	1.10%	-3.32%	0.58%	-7.96%	0.52%

过去六个月	1.56%	1.10%	-0.08%	0.59%	1.64%	0.51%
过去一年	-7.04%	1.21%	-9.67%	0.69%	2.63%	0.52%
过去三年	47.17%	1.44%	-4.48%	0.81%	51.65%	0.63%
自基金合同生效起至今	78.32%	1.40%	3.84%	0.80%	74.48%	0.60%

财通资管价值发现混合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	0.94%	1.29%	0.88%	0.61%	0.06%	0.68%
过去三个月	-11.37%	1.10%	-3.32%	0.58%	-8.05%	0.52%
过去六个月	1.37%	1.10%	-0.08%	0.59%	1.45%	0.51%
过去一年	-7.41%	1.21%	-9.67%	0.69%	2.26%	0.52%
自基金合同生效起至今	-14.93%	1.40%	-16.93%	0.79%	2.00%	0.61%

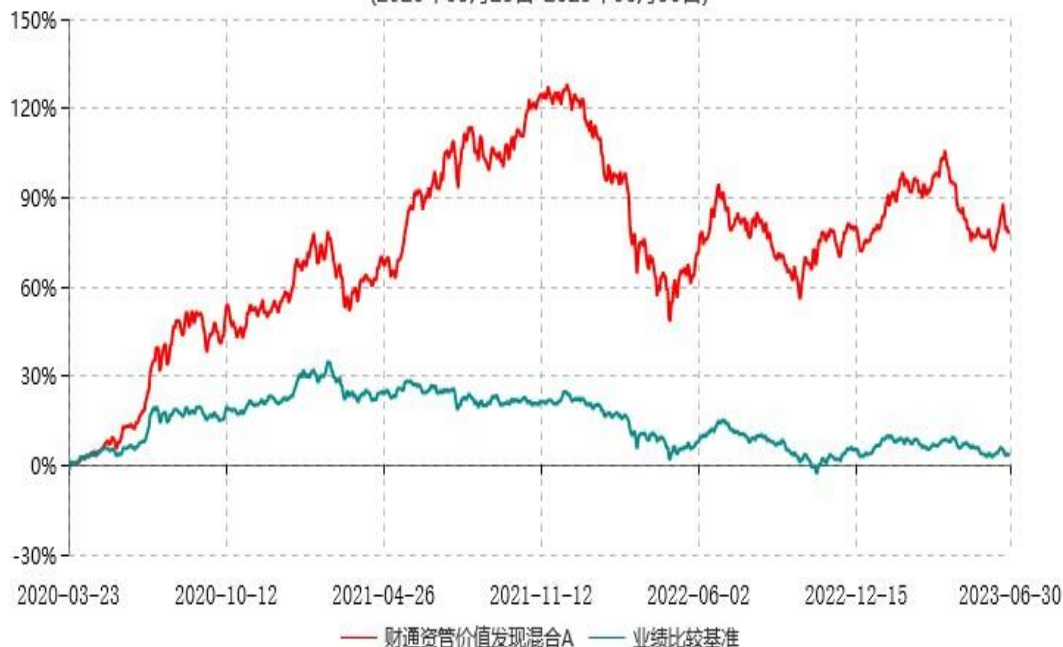
注：1、业绩比较基准：沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%。

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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



财通资管价值发现混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年03月23日-2023年06月30日)



财通资管价值发现混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月21日-2023年06月30日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通证券资产管理有限公司系财通证券股份有限公司的全资子公司，注册资本2亿元人民币。2015年12月，公司获准开展公开募集证券投资基金管理业务。截至2023年6月30日，公司共管理59只基金，分别为财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管价值发现混合型证券投资基金、财通资管行业精选混合型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金、财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管睿慧1年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿安30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管消费升级一年持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿启90天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管中债1-3年国开行债券指数证券投资基金、财通资管中证有色金属指数型发起式证券投资基金、财通资管鸿享30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金、财通资管中证钢铁指数型发起式证券投资基金、财通资管新能源汽车混合型发起式证券投资基金、财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金、财通资管健康产业混合型证券投资基金、财通资管鸿佳60天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管新聚益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管稳兴增益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿商中短债债券型证券投资基金、财通资管双福9个月持有期债券型发起式证券投资基金、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管稳兴丰益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管通达未来6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、财通资管鸿慧中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管通达稳健3个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、财通资管通达稳利3个月定期开放债券型发起式基金中基金（FOF）、财通资管睿盈债券型证券投资基金、财通资管均衡臻选混合型证券投资基金、财通资管双安债券型证券投资基金、财通资管数字经济混合型发起式证

券投资基金、财通资管现金聚财货币市场基金、财通资管臻享成长混合型证券投资基金、财通资管睿兴债券型证券投资基金、财通资管品质消费混合型发起式证券投资基金和财通资管博宏积极6个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜永明	本基金基金经理、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金和财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金基金经理。	2020-03-23	-	13	清华大学工商管理硕士。2009年7月加入平安资产管理有限责任公司，历任行业研究员、股票投资经理、股票投资部负责人、股票投决会委员；2018年12月加入财通证券资产管理有限公司，担任公司总经理助理兼权益投资总监。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》相关规定。

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

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管价值发现混合型证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年上半年，受海外加息、欧美金融风险、国内经济弱复苏等内外部多重因素影响，市场在2月下旬左右结束了普涨行情进入到持续的宽幅震荡行情。行业来看，上半年申万一级行业涨跌分化较为严重，有政策和产业驱动向上的TMT涨幅居前，通信和传媒涨幅高达40%以上，其次是计算机和机械涨幅在10%以上，而传统复苏链普遍较弱，社会服务、食品饮料、房地产、商贸零售等跌幅靠前。

报告期内基金业绩略显被动。期间管理人不断地审视市场和组合，思考价值实现路径，客观地判断公司当下股价和长期价值的关系。从今年上半年来看，基金维持了高仓位运作，持仓结构总体稳定，以成长和消费两条主线为主。今年消费是最早作为复苏链条的领涨板块也是最早走弱的板块，目前已经走弱接近4个月，组合中的次高端和高端成长白酒、啤酒、酒店板块受此影响波动较大；成长中计算机、通信板块相对消费有一定的超额优势，少量增加了军工持仓，以及左侧机会正在慢慢出现的新能源板块和顺周期类资产。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管价值发现混合A基金份额净值为1.7832元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%；截至报告期末财通资管价值发现混合C基金份额净值为1.7705元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.37%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从最新数据来看，经济筑底特征初步形成，且随着政治局会议定调后政策拐点显现，传统的稳增长政策可能会重新成为下一阶段重心。其次，会议对资本市场表态超预期，我们对下半年走势总体看好。盈利角度，在需求和基数效应共同作用下PPI年内有望见底回升，CPI在底部的时间将缩短，企业盈利三季度或见底，同时意味着未来名义GDP增长还是有一定弹性。资金层面，美国6月通胀回落推动美元指数和美债利率边际回落，国内汇率压力有所缓解，对全球资本流向新兴国家有正面作用。投资方向上，长期兼顾价值和成长，价值更多是用消费来替代，此次扩大内需的优先级再提升，消费修复态势向好。同时，下半年会增加一些周期成长股，通常PPI同比见底到转正，一般是主动去库至被动补库阶段，化工行业往往超额收益明显，组合也在寻找成长属性更高的化工等顺周期类资产进行积极布局。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人设有估值工作小组，估值工作小组成员由研究及投资部门、合规稽核部、风险管理部、运营保障部等人员组成。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据及预期信用损失数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内无利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—财通证券资产管理有限公司2023年1月1日至2023年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，财通证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，财通证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：财通资管价值发现混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	102,367,219.18	81,234,286.27
结算备付金		85,071.03	425,002.83
存出保证金		293,615.02	150,137.99
交易性金融资产	6.4.7.2	1,492,047,669.51	1,319,250,196.56
其中：股票投资		1,492,047,669.51	1,318,741,440.12

基金投资		-	-
债券投资		-	508,756.44
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		37,688,760.14	749,989.10
应收股利		-	-
应收申购款		1,689,412.73	5,107,441.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,634,171,747.61	1,406,917,054.46
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022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		-	-
应付清算款		-	2,828,694.76
应付赎回款		50,672,600.00	10,400,008.24
应付管理人报酬		2,095,026.85	1,781,004.31
应付托管费		349,171.16	296,834.08

应付销售服务费		137,302.67	94,659.33
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	584,096.95	451,624.12
负债合计		53,838,197.63	15,852,824.84
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	887,866,144.43	792,932,647.76
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	692,467,405.55	598,131,581.86
净资产合计		1,580,333,549.98	1,391,064,229.62
负债和净资产总计		1,634,171,747.61	1,406,917,054.46

注：报告截止日2023年06月30日，A类基金份额净值1.7832元，C类基金份额净值1.7705元；基金份额总额887,866,144.43份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额657,352,614.57份，C类基金份额总额230,513,529.86份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通资管价值发现混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		4,027,042.11	-544,438,234.64
1.利息收入		393,219.96	564,378.62
其中：存款利息收入	6.4.7.13	393,219.96	564,378.62
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-



证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		36,851,195.77	-260,805,931.29
其中：股票投资收益	6.4.7.14	27,710,606.39	-259,925,039.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,623.56	-8,000,974.20
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	9,137,965.82	7,120,082.42
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.18	-34,156,702.36	-286,487,822.37
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	939,328.74	2,291,140.40
<b>减：二、营业总支出</b>		15,646,294.29	21,132,760.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,616,513.40	17,012,545.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,102,752.24	2,835,424.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	814,531.63	1,148,273.70
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	83.74

8. 其他费用	6.4.7.21	112,497.02	136,433.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,619,252.18	-565,570,995.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,619,252.18	-565,570,995.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,619,252.18	-565,570,995.07

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：财通资管价值发现混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	792,932,647.76	-	598,131,581.86	1,391,064,229.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	792,932,647.76	-	598,131,581.86	1,391,064,229.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	94,933,496.67	-	94,335,823.69	189,269,320.36
（一）、综合收益总额	-	-	-11,619,252.18	-11,619,252.18

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	94,933,496.67	-	105,955,075.87	200,888,572.54
其中: 1.基金申购款	497,252,788.14	-	455,135,518.43	952,388,306.57
2.基金赎回款	-402,319,291.47	-	-349,180,442.56	-751,499,734.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	887,866,144.43	-	692,467,405.55	1,580,333,549.98
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,284,506,182.41	-	1,583,054,833.62	2,867,561,016.03
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产（基金净值）	1,284,506,182.41	-	1,583,054,833.62	2,867,561,016.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-271,345,598.21	-	-654,089,545.72	-925,435,143.93
（一）、综合收益总额	-	-	-565,570,995.07	-565,570,995.07
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-271,345,598.21	-	-88,518,550.65	-359,864,148.86
其中：1.基金申购款	576,364,057.47	-	562,195,228.38	1,138,559,285.85
2.基金赎回款	-847,709,655.68	-	-650,713,779.03	-1,498,423,434.71
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,013,160,584.20	-	928,965,287.90	1,942,125,872.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

钱慧

刘博

刘博

-----  
基金管理人负责人-----  
主管会计工作负责人-----  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

财通资管价值发现混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2019]1832号《关于准予财通资管价值发现混合型证券投资基金注册的批复》注册,由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币323,256,675.58元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0200号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》于2020年3月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为323,361,874.08份基金份额,其中认购资金利息折合105,198.50份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《财通资管价值发现混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费等收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,而不计提销售服务费的基金份额类别,称为A类基金份额;在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为国内依法发行上市的股票(包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为45%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、

应收申购款等，期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%。

本财务报表由本基金的基金管理人财通证券资产管理有限公司于2023年8月30日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至6月30日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除下文6.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资

产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股权投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2)金融负债

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

#### (3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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



么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况

下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号

《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	102,367,219.18
等于：本金	102,345,965.55

加：应计利息	21,253.63
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	102,367,219.18

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,740,188,032.2 1	-	1,492,047,669.5 1	-248,140,362.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,740,188,032.2 1	-	1,492,047,669.5 1	-248,140,362.70

### **6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

#### **6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### **6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

本基金本报告期末未持有期货合约。

#### **6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### **6.4.7.4 买入返售金融资产**

#### **6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### **6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### **6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无

### **6.4.7.5 债权投资**

#### **6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

#### **6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未持有债权投资。

### **6.4.7.6 其他债权投资**

#### **6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### **6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	719.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	483,705.65
其中：交易所市场	483,705.65
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,671.58
应付转出费	0.17
应付转出补差费	0.08
合计	584,096.95

### 6.4.7.10 实收基金

#### 6.4.7.10.1 财通资管价值发现混合A

金额单位：人民币元

项目 (财通资管价值发现混合A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	665,736,707.42	665,736,707.42
本期申购	183,571,450.33	183,571,450.33
本期赎回（以“-”号填列）	-191,955,543.18	-191,955,543.18
本期末	657,352,614.57	657,352,614.57

#### 6.4.7.10.2 财通资管价值发现混合C

金额单位：人民币元

项目 (财通资管价值发现混合C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,195,940.34	127,195,940.34
本期申购	313,681,337.81	313,681,337.81
本期赎回（以“-”号填列）	-210,363,748.29	-210,363,748.29
本期末	230,513,529.86	230,513,529.86

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

##### 6.4.7.12.1 财通资管价值发现混合A

单位：人民币元

项目 (财通资管价值发现混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	367,852,827.61	135,314,948.17	503,167,775.78
本期利润	15,769,750.89	-8,179,772.60	7,589,978.29
本期基金份额交易产生的变动数	-6,435,693.96	10,542,959.78	4,107,265.82
其中：基金申购款	100,281,198.48	66,123,595.46	166,404,793.94
基金赎回款	-106,716,892.44	-55,580,635.68	-162,297,528.12
本期已分配利润	-	-	-



本期末	377,186,884.54	137,678,135.35	514,865,019.89
-----	----------------	----------------	----------------

#### 6.4.7.12.2 财通资管价值发现混合C

单位：人民币元

项目 (财通资管价值发现混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	103,476,778.52	-8,512,972.44	94,963,806.08
本期利润	6,767,699.29	-25,976,929.76	-19,209,230.47
本期基金份额交易产生的变动数	81,316,883.24	20,530,926.81	101,847,810.05
其中：基金申购款	251,607,823.67	37,122,900.82	288,730,724.49
基金赎回款	-170,290,940.43	-16,591,974.01	-186,882,914.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	191,561,361.05	-13,958,975.39	177,602,385.66

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	382,385.41
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	8,994.32
其他	1,840.23
合计	393,219.96

注：其他包括存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	628,279,525.90
减：卖出股票成本总额	598,893,022.18
减：交易费用	1,675,897.33
买卖股票差价收入	27,710,606.39

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益—证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	4,893.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,270.00
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	2,623.56

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	512,850.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	502,270.00
减：应计利息总额	12,850.00

减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,270.00

### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益—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

本基金本报告期内无衍生工具收益—其他投资收益。

### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	9,137,965.82
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,137,965.82

### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-34,156,702.36
——股票投资	-34,158,172.36
——债券投资	1,470.00
——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	-34,156,702.36

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	933,313.63
转换费收入	6,015.11
合计	939,328.74

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。  
2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	12,825.44
合计	112,497.02

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财通证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
财通证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券股份有限公司	382,575,999.19	26.77%	-	-

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	164,996.15	17.72%	47,160.35	9.75%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,616,513.40	17,012,545.28
其中：支付销售机构的客户维护费	3,081,467.43	3,712,625.41

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以1.50%的管理费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,102,752.24	2,835,424.26

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以0.25%的托管费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管价值发现混合A	财通资管价值发现混合C	合计
中国农业 银行股份 有限公司	-	-	-
财通证券 股份有限 公司	-	140,182.09	140,182.09
财通证券 资产管理 有限公司	-	443,258.44	443,258.44
合计	-	583,440.53	583,440.53
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管价值发现混合A	财通资管价值发现混合C	合计
中国农业 银行股份 有限公司	-	-	-
财通证券 股份有限	-	166,149.44	166,149.44

公司			
财通证券 资产管理 有限公司	-	597,938.02	597,938.02
合计	-	764,087.46	764,087.46

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%的年费率计提，具体计算方法如下：每日C类基金份额应计提的基金销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×年费率÷当年天数。基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**  
本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

财通资管价值发现混合A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	12,057,942.58	6,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	5,058,942.58
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-



报告期末持有的基金份额	12,057,942.58	12,057,942.58
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.36%	1.19%

财通资管价值发现混合C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年01月01日至2023年06月30日		2022年01月01日至2022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
中国农业银行股份有限公司	102,367,219.18	382,385.41	101,259,861.20	541,286.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603345	安井食品	2023-02-09	6个月	大宗交易流通受限	147.30	143.03	310,000	45,663.00	44,339.30	-
688515	裕太微	2023-02-01	6个月	新股限售	92.00	162.75	4,183	384,836.00	680,783.25	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股限售	23.77	42.89	1,626	38,650.02	69,739.14	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	新股限售	30.85	23.63	2,782	85,824.70	65,738.66	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	新股限售	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新股限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新股限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	新股限售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股限售	31.59	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新股限售	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6个月	新股限售	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

5、限售证券受限期为对应证券发行公告中的限售期，未上市的证券受限期以成功认购日为起始日。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立规范科学有效的内部风险管理体系结构。董事会是公司风险管理的最高决策机构，授权公司经营管理层建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的具体规章制度，组织实施各类风险的识别与评估工作；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，风险管理部负责拟定公司的风险管理政策、风险管理流程和具体制度，并具体实施，确保公司整

体风险得到有效的识别、监控和管理，确保公司各项内部管理制度得到有效执行。基金管理人业务合规负责人对董事会负责并报告工作，负责监督检查公募基金业务的合法合规性并对内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	-	508,756.44
合计	-	508,756.44

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	102,367,219.18	-	-	-	102,367,219.18
结算备付金	85,071.03	-	-	-	85,071.03
存出保证金	293,615.02	-	-	-	293,615.02
交易性金融资产	-	-	-	1,492,047,669.51	1,492,047,669.51
应收清算款	-	-	-	37,688,760.14	37,688,760.14
应收申购款	-	-	-	1,689,412.73	1,689,412.73
资产总计	102,745,905.23	-	-	1,531,425,842.38	1,634,171,747.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	50,672,600.00	50,672,600.00
应付管理人报酬	-	-	-	2,095,026.85	2,095,026.85
应付托管费	-	-	-	349,171.16	349,171.16
应付销售服务费	-	-	-	137,302.67	137,302.67
其他负债	-	-	-	584,096.95	584,096.95
负债总计	-	-	-	53,838,197.63	53,838,197.63
利率敏感度缺	102,745,905.23	-	-	1,477,587,644.75	1,580,333,549.98



口					
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	81,234,286.27	-	-	-	81,234,286.27
结算备付金	425,002.83	-	-	-	425,002.83
存出保证金	150,137.99	-	-	-	150,137.99
交易性金融资产	508,756.44	-	-	1,318,741,440.12	1,319,250,196.56
应收清算款	-	-	-	749,989.10	749,989.10
应收申购款	-	-	-	5,107,441.71	5,107,441.71
资产总计	82,318,183.53	-	-	1,324,598,870.93	1,406,917,054.46
负债					
应付清算款	-	-	-	2,828,694.76	2,828,694.76
应付赎回款	-	-	-	10,400,008.24	10,400,008.24
应付管理人报酬	-	-	-	1,781,004.31	1,781,004.31
应付托管费	-	-	-	296,834.08	296,834.08
应付销售服务费	-	-	-	94,659.33	94,659.33
其他负债	-	-	-	451,624.12	451,624.12
负债总计	-	-	-	15,852,824.84	15,852,824.84
利率敏感度缺口	82,318,183.53	-	-	1,308,746,046.09	1,391,064,229.62

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2022年12月31日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.04%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022年12月31日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例范围为45%-90%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	1,492,047,669.51	94.41	1,318,741,440.12	94.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,492,047,669.51	94.41	1,318,741,440.12	94.80

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证综指、中小板指、创业板指”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.上证综指、中小板指、创业板指均上升5%	62,585,228.90	68,764,778.59
	2.上证综指、中小板指、创业板指均下降5%	-62,585,228.90	-68,764,778.59

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,446,685,018.31	1,315,629,322.94
第二层次	-	894,619.84
第三层次	45,362,651.20	2,726,253.78
合计	1,492,047,669.51	1,319,250,196.56

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和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，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,492,047,669.51	91.30
	其中：股票	1,492,047,669.51	91.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	102,452,290.21	6.27
8	其他各项资产	39,671,787.89	2.43
9	合计	1,634,171,747.61	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	-	-
B	采矿业	24,610,433.00	1.56
C	制造业	1,000,136,742.23	63.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	74,474.05	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	156,853,345.16	9.93
I	信息传输、软件和信息技术服务业	310,342,087.42	19.64
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	22,847.65	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,492,047,669.51	94.41

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	3,278,455	149,300,840.70	9.45
2	603345	安井食品	979,109	142,564,501.20	9.02
3	002410	广联达	3,972,935	129,080,658.15	8.17
4	600862	中航高科	5,010,301	126,810,718.31	8.02
5	300451	创业慧康	14,491,721	121,440,621.98	7.68
6	600702	舍得酒业	916,499	113,600,051.05	7.19
7	600754	锦江酒店	2,437,949	103,222,760.66	6.53
8	300207	欣旺达	5,241,044	85,533,838.08	5.41
9	300408	三环集团	2,488,952	73,050,741.20	4.62
10	688208	道通科技	2,192,647	66,459,130.57	4.21
11	002180	纳思达	1,654,198	56,656,281.50	3.59
12	600258	首旅酒店	2,830,110	53,630,584.50	3.39

13	300378	鼎捷软件	1,498,441	51,321,604.25	3.25
14	600132	重庆啤酒	541,773	49,929,799.68	3.16
15	603906	龙蟠科技	2,505,834	45,480,887.10	2.88
16	300037	新宙邦	531,824	27,596,347.36	1.75
17	002648	卫星化学	1,691,200	25,300,352.00	1.60
18	603505	金石资源	1,053,980	24,610,433.00	1.56
19	600166	福田汽车	5,876,600	19,980,440.00	1.26
20	000568	泸州老窖	79,200	16,597,944.00	1.05
21	688099	晶晨股份	100,797	8,499,203.04	0.54
22	688515	裕太微	4,183	680,783.25	0.04
23	688496	清越科技	11,760	233,788.80	0.01
24	301358	湖南裕能	1,626	69,739.14	0.00
25	301260	格力博	2,782	65,738.66	0.00
26	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
27	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
28	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
29	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
30	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
31	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
32	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
33	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
34	301280	珠城科技	418	14,947.68	0.00
35	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
36	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
37	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
38	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
39	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
40	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
41	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
42	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
43	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00

44	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
45	001367	海森药业	55	2,171.40	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	603345	安井食品	90,592,179.00	6.51
2	600702	舍得酒业	69,644,257.84	5.01
3	002410	广联达	67,742,990.22	4.87
4	688208	道通科技	66,195,050.71	4.76
5	600754	锦江酒店	65,903,900.52	4.74
6	600862	中航高科	54,385,989.01	3.91
7	300451	创业慧康	45,337,790.90	3.26
8	300207	欣旺达	42,146,127.92	3.03
9	600559	老白干酒	32,676,083.00	2.35
10	002648	卫星化学	29,527,162.58	2.12
11	603505	金石资源	29,024,779.00	2.09
12	600258	首旅酒店	27,168,010.35	1.95
13	300037	新宙邦	25,849,922.90	1.86
14	000063	中兴通讯	23,445,730.00	1.69
15	600166	福田汽车	18,316,765.00	1.32
16	002291	遥望科技	18,315,603.31	1.32
17	000568	泸州老窖	17,136,915.00	1.23
18	002036	联创电子	16,424,660.06	1.18
19	002212	天融信	10,535,217.00	0.76
20	300408	三环集团	9,907,212.10	0.71

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	002230	科大讯飞	114,293,551.46	8.22
2	603039	泛微网络	87,504,182.04	6.29
3	000063	中兴通讯	85,707,145.34	6.16
4	603345	安井食品	53,595,449.00	3.85
5	002212	天融信	47,983,374.72	3.45
6	300378	鼎捷软件	41,020,327.64	2.95
7	600559	老白干酒	25,281,901.32	1.82
8	300768	迪普科技	21,572,099.18	1.55
9	002291	遥望科技	16,395,670.38	1.18
10	600754	锦江酒店	16,271,508.33	1.17
11	600702	舍得酒业	11,354,192.52	0.82
12	002036	联创电子	11,086,702.00	0.80
13	002180	纳思达	9,699,064.90	0.70
14	002410	广联达	9,088,354.52	0.65
15	300451	创业慧康	8,790,998.00	0.63
16	601689	拓普集团	8,762,732.00	0.63
17	002648	卫星化学	7,883,264.00	0.57
18	600862	中航高科	7,815,425.00	0.56
19	300207	欣旺达	6,731,711.01	0.48
20	300408	三环集团	6,325,925.00	0.45

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	806,357,423.93
卖出股票收入（成交）总额	628,279,525.90

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金对股指期货的投资以套期保值为主要目的，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行形势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。本基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，欣旺达电子股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会深圳监管局的处罚。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资有严格的投资决策流程控制，本基金对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的

选择上，本基金严格执行公司个券审核流程。在该证券的持有过程中，研究员密切关注证券发行主体动向，在上述处罚发生时及时分析其对该投资决策的影响。经过分析认为此事件对该证券发行主体的财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此不影响对该证券基本面和投资价值的判断。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	293,615.02
2	应收清算款	37,688,760.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,689,412.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,671,787.89

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603345	安井食品	44,339,300.00	2.81	大宗交易流通受限

### 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，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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
财通资管价值发现混合A	81,365	8,079.06	258,939,721.98	39.39%	398,412,892.59	60.61%
财通资管价值发现混合C	17,635	13,071.37	166,782,680.65	72.35%	63,730,849.21	27.65%
合计	99,000	8,968.34	425,722,402.63	47.95%	462,143,741.80	52.05%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	财通资管价值发现混合A	9,980,004.43	1.52%
	财通资管价值发现混合C	458,792.82	0.20%
	合计	10,438,797.25	1.18%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	财通资管价值发现混合A	>100
	财通资管价值发现混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	财通资管价值发现混合A	>100
	财通资管价值发现混合C	0
	合计	>100

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管价值发现混合A	财通资管价值发现混合C
基金合同生效日(2020年03月23日)基金份额总额	323,361,874.08	-
本报告期期初基金份额总额	665,736,707.42	127,195,940.34
本报告期基金总申购份额	183,571,450.33	313,681,337.81
减：本报告期基金总赎回份额	191,955,543.18	210,363,748.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	657,352,614.57	230,513,529.86

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

### §10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内，2023年6月21日，周志远离任本基金管理人副总经理，担任FICC投资总监。

2、报告期内，无基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	58,795,268.78	4.11%	42,996.84	4.62%	-
长江证券	2	22,597,503.32	1.58%	16,525.59	1.77%	-
东方	2	-	-	-	-	-

财富证券						
东方证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	169,887,367.01	11.89%	124,239.85	13.34%	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	177,024,260.86	12.39%	129,455.46	13.90%	-
天风证券	2	425,145,263.64	29.75%	311,565.19	33.46%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	193,233,337.10	13.52%	141,311.42	15.18%	-
财通证券	3	382,575,999.19	26.77%	164,996.15	17.72%	-

注：a.本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

b.基金交易单元的选择程序如下：

- 1、本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2、基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

c.本报告期内本基金无减少交易单元，新增国海证券两个交易单元。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在上海中欧财富基金销售有限公司新增定期定额投资业务和基金转换业务的公告	证券时报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2023-03-31
2	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在兴业银行股份有限公司新增定期定额投资业务和基金转换业务的公告	同上	2023-04-06
3	财通资管价值发现混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2023-04-20
4	财通资管价值发现混合型证券投资基金招募说明书（更新）2023年第1号	同上	2023-04-20
5	财通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	同上	2023-06-22

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

#### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

### §12 备查文件目录



## 12.1 备查文件目录

- 1、财通资管价值发现混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管价值发现混合型证券投资基金托管协议
- 4、财通资管价值发现混合型证券投资基金基金合同
- 5、财通资管价值发现混合型证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层  
浙江省杭州市上城区新业路中国人寿大厦2幢22层

## 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)

财通证券资产管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日