财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:**2020** 年 **03** 月 **27** 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2019年1月1日起至2019年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 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、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 审计报告 15
6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 21
7.4 报表附注 23
§8 投资组合报告 52
8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 63
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 63
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 63

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 63
8.12 投资组合报告附注 63
§9 基金份额持有人信息 64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 65
§10 开放式基金份额变动 65
§11 重大事件揭示 65
11.1 基金份额持有人大会决议 65
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 65
11.4 基金投资策略的改变 65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 66
11.8 其他重大事件 69
§12 影响投资者决策的其他重要信息 74
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 **20%**的情况 74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 74
§13 备查文件目录 74
13.1 备查文件目录 74
13.2 存放地点 74
13.3 查阅方式 75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	财通资管消费精选混合
基金主代码	005682
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年04月02日
基金管理人	财通证券资产管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,287,117,327.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司，以分享中国经济增长与结构转型带来的投资机会，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，在分析和判断宏观经济周期和金融市场运行趋势的基础上，自上而下调整基金大类资产配置和股票行业配置策略，确定债券组合久期和债券类别配置；在严谨深入的股票和债券研究分析基础上，自下而上精选个券。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%＋中债综合指数收益率×40%
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	中国工商银行股份有限公司
信息披	姓名	刘泉	郭明

露负责人	联系电话	021-20568203	010-66105799
	电子邮箱	lq@ctzg.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95336	95588
传真		021-68753502	010-66105798
注册地址		浙江省杭州市上城区白云路26号143室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		马晓立	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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四宜路22号四宜大院B幢

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年	2018年04月02日（基金合同生效日）-2018年12月31日

本期已实现收益	111,758,512.81	-84,471,860.06
本期利润	211,399,324.76	-89,167,413.79
加权平均基金份额本期利润	0.2712	-0.2215
本期加权平均净值利润率	21.94%	-25.14%
本期基金份额净值增长率	76.93%	-23.37%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	298,768,974.53	-82,233,390.61
期末可供分配基金份额利润	0.2321	-0.2337
期末基金资产净值	1,745,015,649.35	269,623,146.30
期末基金份额净值	1.3558	0.7663
3.1.3 累计期末指标	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	35.58%	-23.37%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.32%	0.82%	4.67%	0.44%	-0.35%	0.38%
过去六个月	28.56%	1.09%	4.75%	0.51%	23.81%	0.58%
过去一年	76.93%	1.33%	21.49%	0.74%	55.44%	0.59%

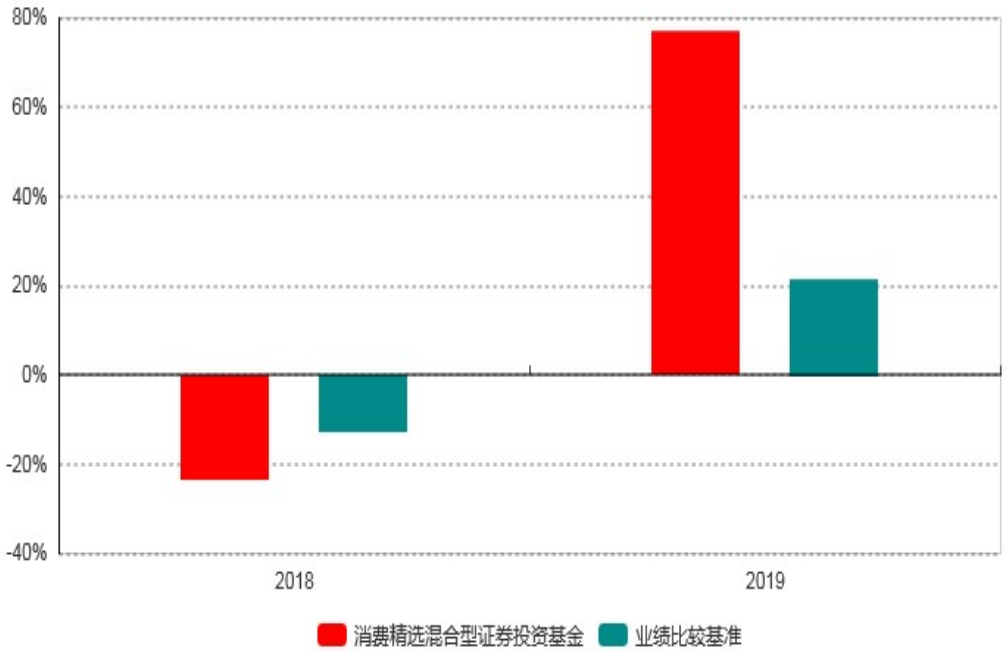
自基金合同生效起至今	35.58%	1.32%	6.00%	0.78%	29.58%	0.54%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%＋中债综合指数收益率×40%
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

注：自基金合同生效至报告期末，财通资管消费精选基金份额净值增长率为35.58%，同期业绩比较基准收益率为6.00%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于2018年4月2日生效，本基金自成立以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通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2019年12月31日，公司共管理17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、财通资管中证

500指数增强型证券投资基金（LOF）、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金和财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金。

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		
于洋	本基金基金经理、财通资管鑫逸回报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和财通资管价值成长混合型证券投资基金基金经理。	2018-09-14	-	12	金融学硕士，历任申银万国证券研究所有限公司研究员；瑞银证券有限责任公司研究员、研究部副董事；富国基金管理有限公司投资经理。2018年4月加入财通证券资产管理有限公司。
邓希	本基金基金经理助理。	2019-04-15	2019-07-08	5	英国华威大学数学经济学士、华威商学院金融数学硕士。2014年7月起加入财通证券股份有限公司资产管理部，2015年8月内部调动至财通证券资产管理有限公司（原财通证券股份有限公司资产管理部），历任权益私募投资部投研助理、量化投资经理助理、量化投资经理、权益公募投资部部门助理。

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行业协会《证券从业人员资格管理办法》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

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《财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《财通资管消费精选灵活配置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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制、银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；2、对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理，确保公平对待所有投资组合。

事后评估及反馈表现为对各基金投资组合公平交易进行事后分析，于每季度对公司管理的不同基金投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2019年市场整体表现较为强势，全年指数逐级震荡上行，市场结构性机会明显，白马价值和成长股均有较好表现，上半年价值因子占优势，下半年则成长因子明显跑赢，整体呈现较为明显的行业轮动趋势。我们认为，后期随着经济企稳，市场风险偏好逐级提升，成长和估值匹配性较好的公司仍将继续得到市场关注。

在报告期内，组合继续采用"自上而下"和"自下而上"相结合策略，精选行业和个股，并坚持"高胜率、低波动"原则，争取提升组合风险调整后收益水平。投资配置上，我们继续秉承深度研究、价值投资、长期持股的投资理念，希望通过精选景气行业和在景气行业中优选基本面良好的优秀公司，分享行业和公司长期成长所创造的价值。在选股层面，我们继续看好行业景气度稳步向上、与经济周期弱相关的行业里管理能力优秀、风险转嫁能力强、治理机构良好的公司，这是在当前环境下最稳妥的投资方向。具体而言，我们看好的方向包括与衣食住行用密切相关的泛消费领域，例如具有定价能力的大众消费品（食品、医药等），无论从需求还是消费升级来看，中国的消费品长期需求增长潜力巨大，相关品牌有望迎来长期发展空间；虽然短期受到贸易战影响，但从中长期来看科技行业（消费电子， 计算机、 5G等）中也将涌现出一批头部公司，未来他们将成为中国经济发展和科技创新的核心动力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管消费精选混合基金份额净值为1.3558元，本报告期内，基金份额净值增长率为76.93%，同期业绩比较基准收益率为21.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间，我们依然保持谨慎乐观态度，我们认为市场或仍将呈现震荡盘升的态势，后期市场中枢仍有望继续上行，板块仍有结构性机会。首先，虽然整体经济仍有下行压力，但随着后期库存周期见底，经济有望阶段性企稳，这将有利于稳定上市公司业绩增速和提升投资者风险偏好水平；其次，后期中美贸易纷争或将暂告一段落，短期影响将逐步变为长期因素，市场将逐步消化其对估值和盈利的干扰，降低其权重占比；最后，2020年市场整体剩余流动性依然充裕，随着年报季到来，我们认为一些业绩可能超预期的白马品种或将继续得到资金青睐，结构性行情依然可以继续期待。因此在下一阶段，我们将继续保持中性偏高仓位进行操作，在个股筛选上，继续选择经营管理

优秀、行业地位突出、抗风险能力强的优质行业龙头进行配置，希望通过分享企业长期内生增长动力来争取组合净值稳步增长。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019年，合规负责人和合规稽核部持续完善合规管理制度体系，扎实推进合规文化建设，全面有效地开展合规审查与稽核检查工作，进而提升合规与稽核管理工作的质量和实效，确保公司各项业务和日常经营合规、平稳和高效运行。

（一）持续完善合规管理制度体系

根据法律法规的新变化、结合行业发展的新动态、围绕业务开展的新需要，适时组织更新合规稽核管理制度，落实合规管理全流程要求，着力重新梳理并进一步完善公司合规管理体系，不断优化内控环节，持续创新操作流程，使得合规管理制度体系进一步完善。

（二）扎实推进合规文化建设

2019年度，合规稽核部通过组织外部律师或内部合规人员开展合规培训、全员合规考试、合规理念传导、重要法规政策解读、合规学习材料编写、监管会议精神传达等多种方式，确保常态化的合规文化建设机制正常运行，使得公司员工守法合规和诚实守信的意识得到提高，强化"全员合规、合规从管理层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础"企业合规文化理念，为公司业务的规范和健康发展提供良好的文化土壤。

（三）全面有效开展日常合规管理

1、合规法务审查

依照法律法规、监管要求及公司制度规定，从法律合规角度向公司各大业务板块和职能部门提供全面支持和服务保障，并对新业务、新产品、重大决策事项从管理程序、潜在风险和防控措施等方面提出法律合规审查意见，确保公司各项的业务能够合法合规开展。

2、合规咨询与建议

在日常业务开展以及公司经营管理过程中，通过邮件、口头等方式提供合规咨询与建议服务，与公司各部门积极沟通并协调解决业务办理过程中遇到的各类难题，全程提供合规支持。

3、员工执业与投资行为管理

在员工执业行为管理方面，重新梳理并修订了员工申报管理制度。对投资管理人员通讯工具集中管理予以督促并定期检查，定期对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录执行合规检查。通过常态化的员工执业和投资行为合规管理机制，促使员工执业和投资行为持续符合监管要求。

4、反洗钱合规管理

2019年度除了日常开展可疑交易监控排查、监控黑名单更新、协助开展客户风险等级划分等相关工作外，完成《2018年度反洗钱工作报告》，开展了2018年度反洗钱金融机构分类评级自评。

（四）加强合规检查与专项审计

按照法律法规以及监管机构的要求，定期对公司各业务部门执行制度的情况进行合规检查和专项审计，查漏补缺、排查隐患、防范潜在风险。并就专项审计发现问题与相关部门制定整改方案；同时加大整改跟踪力度和调整跟进方法。专项审计和合规检查工作促进了公司内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4.7 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公司分管高管、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，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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未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

本报告期内，本基金托管人在对财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不

存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——财通证券资产管理有限公司在财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人依法对财通证券资产管理有限公司编制和披露的财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金2019年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 20654 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	（一） 我们审计的内容 我们审计了财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“财通资管消费精选混合”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 （二） 我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照

	企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了财通资管消费精选混合 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于财通资管消费精选混合，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	财通资管消费精选混合的基金管理人财通证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估财通资管消费精选混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算财通资管消费精选混合、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督财通资管消费精选混合的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于

	舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （三） 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （四） 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对财通资管消费精选混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致财通资管消费精选混合不能持续经营。 （五） 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交

	易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	薛 竞	叶 尔 甸
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼	
审计报告日期	2020-03-26	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	238,164,613.03	29,824,900.13
结算备付金		7,646,566.14	1,205,191.90
存出保证金		923,499.31	496,847.86
交易性金融资产	7.4.7.2	1,569,653,284.48	232,096,182.58
其中：股票投资		1,557,483,717.48	216,190,504.18
基金投资		-	-
债券投资		12,169,567.00	15,905,678.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	30,000,300.00
应收证券清算款		-	1,347,963.73

应收利息	7.4.7.5	303,621.27	450,177.90
应收股利		-	-
应收申购款		540,236.06	1,477.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,817,231,820.29	295,423,041.93
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,117,266.34	24,741,160.50
应付赎回款		60,663,391.51	116,115.31
应付管理人报酬		2,939,469.64	354,171.06
应付托管费		489,911.61	59,028.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,699,338.37	398,653.85
应交税费		11.51	328.77
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	306,781.96	130,437.64
负债合计		72,216,170.94	25,799,895.63
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,287,117,327.85	351,856,536.91
未分配利润	7.4.7.10	457,898,321.50	-82,233,390.61
所有者权益合计		1,745,015,649.35	269,623,146.30
负债和所有者权益总计		1,817,231,820.29	295,423,041.93

注：报告截止日2019年12月31日，基金份额净值1.3558元，基金份额总额1,287,117,327.85份。

7.2 利润表

会计主体：财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年01月01日 至2019年12月31日	上年度可比期间2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
一、收入		238,862,418.82	-78,333,814.21
1.利息收入		2,937,053.24	2,119,447.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,552,201.28	448,412.20
债券利息收入		353,093.90	404,606.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		31,758.06	1,266,429.53
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		132,195,888.71	-76,488,100.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	129,146,638.30	-76,948,160.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,292,336.08	-1,759,401.75
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,756,914.33	2,219,461.32
3.公允价值变动收益（损	7.4.7.16	99,640,811.95	-4,695,553.73

失以“-”号填列）			
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,088,664.92	730,392.43
减：二、费用		27,463,094.06	10,833,599.58
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	14,670,928.79	3,991,951.00
2．托管费	7.4.10.2.2	2,445,154.71	665,325.07
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.18	10,174,804.52	6,038,127.51
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		22.29	4,583.53
7．其他费用	7.4.7.19	172,183.75	133,612.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		211,399,324.76	-89,167,413.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		211,399,324.76	-89,167,413.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	351,856,536.91	-82,233,390.61	269,623,146.30

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	211,399,324.76	211,399,324.76
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）	935,260,790.94	328,732,387.35	1,263,993,178.29
其中：1.基金申购款	2,177,856,017.10	682,820,027.40	2,860,676,044.50
2.基金赎回款	-1,242,595,226.16	-354,087,640.05	-1,596,682,866.21
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）	1,287,117,327.85	457,898,321.50	1,745,015,649.35
项 目	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	569,838,633.50	-	569,838,633.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-89,167,413.79	-89,167,413.79
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	-217,982,096.59	6,934,023.18	-211,048,073.41

列）			
其中：1.基金申购款	1,888,366.82	-303,346.24	1,585,020.58
2.基金赎回款	-219,870,463.41	7,237,369.42	-212,633,093.99
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）	351,856,536.91	-82,233,390.61	269,623,146.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

马晓立	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

财通资管消费精选灵活配置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[2018]106号《关于准予财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《财通资管消费精选灵活配置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569,691,992.47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(2018) 第0234号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年4月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为569,838,633.50份基金份额，其中认购资金利息折合146,641.03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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、定期存款及其他银行存款)、同业存单、衍生品(包括权证、股指期货、国债期货等)、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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0%-95%，投资于本基金定义的消费行业的证券不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%＋中债综合指数收益率×40%。

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2020年3月26日批准报出。

7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年度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2019年12月31日的财务状况以及2019年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。比较财务报表的实际编制期间为2018年4月2日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。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。

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。

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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和债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、资产支持证券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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、资产支持证券和私募债券除外)，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。

本基金确定资产支持证券的公允价值时采用估值技术。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	238,164,613.03	29,824,900.13
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	238,164,613.03	29,824,900.13

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,462,541,589.94	1,557,483,717.48	94,942,127.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	12,166,436.32	12,169,567.00	3,130.68
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,166,436.32	12,169,567.00	3,130.68
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,474,708,026.26	1,569,653,284.48	94,945,258.22
项目		上年度末2018年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		220,913,835.77	216,190,504.18	-4,723,331.59
贵金属投资-金交所黄		-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	15,877,900.54	15,905,678.40	27,777.86
	银行间市场	-	-	-
	合计	15,877,900.54	15,905,678.40	27,777.86
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		236,791,736.31	232,096,182.58	-4,695,553.73

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	30,000,300.00	-
银行间市场	-	-
合计	30,000,300.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2019年12月31日	2018年12月31日
应收活期存款利息	57,485.93	6,534.82
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	3,785.10	596.53
应收债券利息	241,893.08	442,800.59
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	457.16	245.96
合计	303,621.27	450,177.90

注：其他包括应收保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,699,338.37	398,653.85
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,699,338.37	398,653.85

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	146,781.96	437.64

预提费用	160,000.00	130,000.00
应付证券出借违约金	-	-
合计	306,781.96	130,437.64

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	351,856,536.91	351,856,536.91
本期申购	2,177,856,017.10	2,177,856,017.10
本期赎回（以“-”号填列）	-1,242,595,226.16	-1,242,595,226.16
本期末	1,287,117,327.85	1,287,117,327.85

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-75,040,795.88	-7,192,594.73	-82,233,390.61
本期利润	111,758,512.81	99,640,811.95	211,399,324.76
本期基金份额交易产生的变动数	262,051,257.60	66,681,129.75	328,732,387.35
其中：基金申购款	477,609,483.29	205,210,544.11	682,820,027.40
基金赎回款	-215,558,225.69	-138,529,414.36	-354,087,640.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	298,768,974.53	159,129,346.97	457,898,321.50

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
活期存款利息收入	2,483,882.15	371,064.15

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	62,387.44	73,444.23
其他	5,931.69	3,903.82
合计	2,552,201.28	448,412.20

注：其他包括存出保证金和直销申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出股票成交总额	3,929,869,671.21	2,390,059,535.10
减：卖出股票成本总额	3,800,723,032.91	2,467,007,695.32
买卖股票差价收入	129,146,638.30	-76,948,160.22

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,292,336.08	-1,759,401.75
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,292,336.08	-1,759,401.75

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	55,003,058.01	81,867,168.82
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	53,004,246.72	83,330,290.18
减：应收利息总额	706,475.21	296,280.39
买卖债券差价收入	1,292,336.08	-1,759,401.75

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,756,914.33	2,219,461.32
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	1,756,914.33	2,219,461.32

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
1.交易性金融资产	99,640,811.95	-4,695,553.73
——股票投资	99,665,459.13	-4,723,331.59

——债券投资	-24,647.18	27,777.86
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	99,640,811.95	-4,695,553.73

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
基金赎回费收入	4,088,603.30	730,392.33
转换费收入	61.62	0.10
合计	4,088,664.92	730,392.43

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
交易所市场交易费用	10,174,804.52	6,038,127.51
银行间市场交易费用	-	-

合计	10,174,804.52	6,038,127.51

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
审计费用	40,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
汇划手续费	12,183.75	3,212.47
证券出借违约金	-	-
其他费用	-	400.00
合计	172,183.75	133,612.47

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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。

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
中国工商银行股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券股份有限公司	4,972,222,469.46	55.54%	2,280,874,894.80	44.93%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券股份有限公司	55,632,625.43	92.00%	97,158,253.76	55.47%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期债券回

		购成交总额的比例		购成交总额的比例
财通证券股份有限公司	369,000,000.00	100.00%	5,494,400,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	2,495,365.19	46.16%	1,318,554.51	48.85%
关联方名称	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	1,239,142.55	37.74%	160,023.27	40.14%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,670,928.79	3,991,951.00
其中：支付销售机构的客户维护费	10,294,110.33	2,829,970.42

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以1.50%的管理费年费率来计算，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,445,154.71	665,325.07

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以0.25%的托管费年费率来计算，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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年04月02日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	238,164,613.03	2,483,882.15	29,824,900.13	371,064.15

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	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
601658	邮储银行	2019-12-02	2020-06-10	新发流通受限	5.50	5.71	797,310	4,385,205.00	4,552,640.10	-

003816	中国广核	2019-08-14	2020-02-27	新发流通受限	2.49	3.53	244,764	609,462.36	864,016.92	-
688066	航天宏图	2019-07-16	2020-01-22	新发流通受限	17.25	37.17	15,134	261,061.50	562,530.78	-
688011	新光光电	2019-07-12	2020-01-22	新发流通受限	38.09	41.05	8,807	335,458.63	361,527.35	-
688166	博瑞医药	2019-10-29	2020-05-08	新发流通受限	12.71	25.64	8,041	102,201.11	206,171.24	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新发流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
128085	鸿达转债	2019-12-18	2020-01-08	新发流通受限	100.00	100.00	3,040	304,000.00	304,000.00	-
128084	木森转债	2019-12-18	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	2,370	237,000.00	237,000.00	-
113029	明阳转债	2019-12-18	2020-01-07	新发流通受限	100.00	100.00	1,890	189,000.00	189,000.00	-
128086	国轩转债	2019-12-19	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	1,830	183,000.00	183,000.00	-
110065	淮矿转债	2019-12-	2020-01-	新发流通	100.00	100.00	1,680	168,000.	168,000.	-

		25	13	受限				00	00	
113554	仙鹤转债	2019-12-18	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	1,090	109,000.00	109,000.00	-
113030	东风转债	2019-12-26	2020-01-20	新发流通受限	100.00	100.00	280	28,000.00	28,000.00	-

注：1、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。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末及上年度末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人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工商银行股份有限公司。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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末

	2019年12月31日	2018年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	10,951,567.00	-
合计	10,951,567.00	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	168,000.00	-
AAA以下	1,050,000.00	15,905,678.40
未评级	-	-
合计	1,218,000.00	15,905,678.40

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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2019年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约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(所有者权益)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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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》(自2017年10月1日起施行)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该比例限制)。

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7.4.12。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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有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、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019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	238,164,613.03	-	-	-	238,164,613.03
结算备付金	7,646,566.14	-	-	-	7,646,566.14
存出保证金	923,499.31	-	-	-	923,499.31
交易性金融资产	10,951,567.00	-	1,218,000.00	1,557,483,717.48	1,569,653,284.48
应收利息	-	-	-	303,621.27	303,621.27
应收申	-	-	-	540,236.06	540,236.06

购款					
资产总计	257,686,245.48	-	1,218,000.00	1,558,327,574.81	1,817,231,820.29
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,117,266.34	5,117,266.34
应付赎回款	-	-	-	60,663,391.51	60,663,391.51
应付管理人报酬	-	-	-	2,939,469.64	2,939,469.64
应付托管费	-	-	-	489,911.61	489,911.61
应付交易费用	-	-	-	2,699,338.37	2,699,338.37
应交税费	-	-	-	11.51	11.51
其他负债	-	-	-	306,781.96	306,781.96
负债总计	-	-	-	72,216,170.94	72,216,170.94
利率敏感度缺口	257,686,245.48	-	1,218,000.00	1,486,111,403.87	1,745,015,649.35
上年度末2018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	29,824,900.13	-	-	-	29,824,900.13
结算备付金	1,205,191.90	-	-	-	1,205,191.90
存出保证金	496,847.86	-	-	-	496,847.86
交易性金融资产	15,905,678.40	-	-	216,190,504.18	232,096,182.58

买入返售金融资产	30,000,300.00	-	-	-	30,000,300.00
应收证券清算款	-	-	-	1,347,963.73	1,347,963.73
应收利息	-	-	-	450,177.90	450,177.90
应收申购款	-	-	-	1,477.83	1,477.83
资产总计	77,432,918.29	-	-	217,990,123.64	295,423,041.93
负债					
应付证券清算款	-	-	-	24,741,160.50	24,741,160.50
应付赎回款	-	-	-	116,115.31	116,115.31
应付管理人报酬	-	-	-	354,171.06	354,171.06
应付托管费	-	-	-	59,028.50	59,028.50
应付交易费用	-	-	-	398,653.85	398,653.85
应交税费	-	-	-	328.77	328.77
其他负债	-	-	-	130,437.64	130,437.64
负债总计	-	-	-	25,799,895.63	25,799,895.63
利率敏感度缺口	77,432,918.29	-	-	192,190,228.01	269,623,146.30

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019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资产净值的比例为0.70%（2018年12月31日：5.90%）。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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0%-95%，投资于本基金定义的消费行业的证券不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货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，权证、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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018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	1,557,483,717.48	89.25	216,190,504.18	80.18
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	1,557,483,717.48	89.25	216,190,504.18	80.18

7.4.13.4.3.2 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
	1.上证综指、中小板指、创业板指指数均上升5%	87,382,497.13	12,915,099.69
	2.上证综指、中小板指、创业板指指数均下降5%	-87,382,497.13	-12,915,099.69

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2019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1,550,930,253.05元，属于第二层次的余额为18,723,031.43元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次216,190,504.18元，第二层次15,905,678.40元，无第三层次)。

(ii)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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018年12月31日：同)。

(d)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。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,557,483,717.48	85.71
	其中：股票	1,557,483,717.48	85.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,169,567.00	0.67
	其中：债券	12,169,567.00	0.67

	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	245,811,179.17	13.53
8	其他各项资产	1,767,356.64	0.10
9	合计	1,817,231,820.29	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,151,208,845.36	65.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	864,373.32	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	32,404,365.00	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	192,689,537.68	11.04
J	金融业	62,914,641.46	3.61
K	房地产业	117,395,376.62	6.73
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	-
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	1,557,483,717.48	89.25

注：由于四舍五入的原因金额占基金资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	4,226,083	149,561,077.37	8.57
2	688166	博瑞医药	3,215,052	102,092,910.71	5.85
3	600519	贵州茅台	77,855	92,102,465.00	5.28
4	688111	金山办公	561,791	92,077,544.90	5.28
5	688363	华熙生物	1,076,867	89,810,707.80	5.15
6	300750	宁德时代	676,559	71,985,877.60	4.13
7	000977	浪潮信息	2,237,559	67,350,525.90	3.86
8	002912	中新赛克	511,900	64,499,400.00	3.70
9	000661	长春高新	137,942	61,660,074.00	3.53
10	600048	保利地产	3,688,379	59,677,972.22	3.42
11	601318	中国平安	682,916	58,362,001.36	3.34
12	000002	万 科A	1,793,580	57,717,404.40	3.31
13	002273	水晶光电	3,499,462	56,551,305.92	3.24
14	300014	亿纬锂能	1,116,998	56,028,619.68	3.21
15	600887	伊利股份	1,768,443	54,715,626.42	3.14
16	300115	长盈精密	3,053,900	54,328,881.00	3.11
17	300122	智飞生物	1,067,055	52,989,951.30	3.04
18	600809	山西汾酒	580,203	52,044,209.10	2.98

19	002180	纳思达	1,316,438	43,337,138.96	2.48
20	300601	康泰生物	484,246	42,511,956.34	2.44
21	002212	南洋股份	1,931,765	36,722,852.65	2.10
22	688008	澜起科技	509,805	36,507,136.05	2.09
23	688039	当虹科技	428,314	35,550,062.00	2.04
24	600009	上海机场	411,484	32,404,365.00	1.86
25	002241	歌尔股份	1,531,444	30,506,364.48	1.75
26	601658	邮储银行	797,310	4,552,640.10	0.26
27	003816	中国广核	244,863	864,373.32	0.05
28	688066	航天宏图	15,134	562,530.78	0.03
29	688011	新光光电	8,807	361,527.35	0.02
30	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
31	603109	N神驰	684	18,105.48	0.00
32	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	252,105,881.39	93.50
2	000063	中兴通讯	168,615,900.56	62.54
3	600183	生益科技	158,211,270.65	58.68
4	688363	华熙生物	146,201,473.69	54.22
5	600048	保利地产	131,846,649.35	48.90
6	688008	澜起科技	129,406,276.02	48.00
7	000002	万 科A	121,651,882.98	45.12
8	002273	水晶光电	120,931,511.99	44.85
9	603068	博通集成	120,402,860.60	44.66
10	000977	浪潮信息	120,223,917.00	44.59
11	603369	今世缘	119,383,067.39	44.28
12	000661	长春高新	117,091,431.44	43.43

13	603986	兆易创新	115,430,791.58	42.81
14	688111	金山办公	106,602,950.27	39.54
15	603259	药明康德	104,452,500.61	38.74
16	688166	博瑞医药	101,534,659.83	37.66
17	601601	中国太保	99,741,723.68	36.99
18	600703	三安光电	98,361,499.43	36.48
19	600867	通化东宝	89,078,733.11	33.04
20	601318	中国平安	88,613,705.28	32.87
21	300014	亿纬锂能	85,765,138.04	31.81
22	002241	歌尔股份	82,682,646.82	30.67
23	300146	汤臣倍健	80,775,258.34	29.96
24	002897	意华股份	80,562,373.19	29.88
25	300529	健帆生物	78,295,009.55	29.04
26	300750	宁德时代	77,009,236.25	28.56
27	601233	桐昆股份	75,093,220.56	27.85
28	600529	山东药玻	72,138,043.86	26.76
29	002508	老板电器	69,269,260.02	25.69
30	603501	韦尔股份	69,063,931.64	25.61
31	002912	中新赛克	69,000,575.00	25.59
32	600009	上海机场	68,919,459.07	25.56
33	600887	伊利股份	68,559,248.36	25.43
34	000799	酒鬼酒	67,614,690.15	25.08
35	300408	三环集团	65,738,863.56	24.38
36	603228	景旺电子	63,554,538.94	23.57
37	603707	健友股份	59,628,225.40	22.12
38	300122	智飞生物	56,758,729.45	21.05
39	300311	任子行	55,619,713.62	20.63
40	603833	欧派家居	55,251,447.09	20.49
41	300115	长盈精密	55,221,375.41	20.48
42	300003	乐普医疗	54,568,807.76	20.24
43	002180	纳思达	53,106,071.24	19.70

44	300601	康泰生物	52,615,389.60	19.51
45	002212	南洋股份	52,456,690.31	19.46
46	600809	山西汾酒	51,871,393.09	19.24
47	000938	紫光股份	41,634,403.00	15.44
48	688039	当虹科技	37,952,048.57	14.08
49	603377	东方时尚	36,079,373.93	13.38
50	300709	精研科技	35,674,208.00	13.23
51	000651	格力电器	30,457,972.72	11.30
52	002410	广联达	28,873,060.20	10.71
53	002557	洽洽食品	21,818,122.80	8.09
54	000858	五 粮 液	20,772,472.07	7.70
55	002230	科大讯飞	19,329,456.05	7.17
56	002216	三全食品	19,158,511.26	7.11
57	600559	老白干酒	17,018,559.35	6.31
58	601155	新城控股	16,884,778.48	6.26
59	300498	温氏股份	16,837,451.62	6.24
60	002044	美年健康	16,448,987.73	6.10
61	300679	电连技术	15,688,034.32	5.82
62	601939	建设银行	14,509,775.67	5.38
63	600837	海通证券	13,909,152.00	5.16
64	000975	银泰黄金	13,522,626.76	5.02
65	300595	欧普康视	13,518,564.43	5.01
66	600383	金地集团	13,510,346.88	5.01
67	002405	四维图新	12,519,597.72	4.64
68	002078	太阳纸业	12,041,935.75	4.47
69	600498	烽火通信	11,250,819.00	4.17
70	002821	凯莱英	10,700,239.00	3.97
71	600547	山东黄金	10,597,204.66	3.93
72	601899	紫金矿业	10,521,683.00	3.90
73	000568	泸州老窖	10,018,925.78	3.72
74	601933	永辉超市	9,824,824.25	3.64

75	300001	特锐德	9,331,748.00	3.46
76	603859	能科股份	8,225,528.00	3.05
77	603186	华正新材	8,182,976.00	3.03
78	000333	美的集团	8,147,900.40	3.02
79	600690	海尔智家	8,108,826.00	3.01
80	600406	国电南瑞	8,073,275.05	2.99
81	600521	华海药业	7,759,909.20	2.88
82	300059	东方财富	7,670,296.00	2.84
83	601688	华泰证券	7,494,111.61	2.78
84	600036	招商银行	7,044,286.09	2.61
85	002572	索菲亚	6,995,796.60	2.59
86	002100	天康生物	6,872,666.01	2.55
87	600131	岷江水电	6,665,930.93	2.47
88	600486	扬农化工	6,483,620.16	2.40
89	300759	康龙化成	6,333,582.48	2.35
90	601658	邮储银行	6,264,571.50	2.32
91	300347	泰格医药	6,162,416.20	2.29
92	002796	世嘉科技	6,053,967.39	2.25
93	002841	视源股份	6,026,557.00	2.24
94	300575	中旗股份	6,014,503.00	2.23
95	002223	鱼跃医疗	5,571,688.00	2.07

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。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	187,317,235.54	69.47
2	600183	生益科技	146,371,446.18	54.29
3	603986	兆易创新	132,189,836.88	49.03
4	603369	今世缘	129,414,353.42	48.00
5	603068	博通集成	116,212,528.35	43.10

6	603259	药明康德	110,176,521.32	40.86
7	600703	三安光电	102,234,178.98	37.92
8	688008	澜起科技	101,751,723.19	37.74
9	601601	中国太保	96,979,576.27	35.97
10	000661	长春高新	91,517,114.71	33.94
11	600867	通化东宝	85,927,133.67	31.87
12	600529	山东药玻	84,635,528.67	31.39
13	300529	健帆生物	77,737,913.79	28.83
14	000002	万 科A	76,301,807.10	28.30
15	300146	汤臣倍健	76,175,546.50	28.25
16	600048	保利地产	74,403,611.68	27.60
17	603501	韦尔股份	73,834,696.36	27.38
18	002897	意华股份	73,773,439.70	27.36
19	002508	老板电器	70,984,897.58	26.33
20	603707	健友股份	70,479,487.92	26.14
21	601233	桐昆股份	70,442,344.04	26.13
22	002273	水晶光电	70,029,693.73	25.97
23	000977	浪潮信息	64,554,304.73	23.94
24	000799	酒鬼酒	63,480,117.69	23.54
25	002241	歌尔股份	62,775,332.52	23.28
26	300408	三环集团	59,698,810.56	22.14
27	603228	景旺电子	58,794,760.75	21.81
28	300003	乐普医疗	53,615,291.50	19.89
29	300311	任子行	52,544,498.37	19.49
30	603833	欧派家居	50,117,071.30	18.59
31	300014	亿纬锂能	44,455,523.04	16.49
32	000938	紫光股份	40,383,758.72	14.98
33	002410	广联达	39,496,104.31	14.65
34	688363	华熙生物	38,392,519.46	14.24
35	000063	中兴通讯	37,507,462.22	13.91
36	601318	中国平安	37,025,256.18	13.73

37	300750	宁德时代	35,589,375.00	13.20
38	600009	上海机场	35,035,824.16	12.99
39	688111	金山办公	32,998,993.89	12.24
40	300709	精研科技	32,642,978.02	12.11
41	000651	格力电器	29,439,687.78	10.92
42	000858	五 粮 液	29,350,556.71	10.89
43	002912	中新赛克	28,738,014.85	10.66
44	603377	东方时尚	27,172,067.39	10.08
45	600887	伊利股份	27,046,078.64	10.03
46	002557	洽洽食品	25,412,235.02	9.43
47	002230	科大讯飞	25,024,649.83	9.28
48	002216	三全食品	23,038,693.95	8.54
49	002044	美年健康	22,919,192.85	8.50
50	601155	新城控股	22,249,953.26	8.25
51	600498	烽火通信	17,574,152.40	6.52
52	600570	恒生电子	16,846,138.71	6.25
53	600559	老白干酒	16,699,178.47	6.19
54	600383	金地集团	16,014,202.01	5.94
55	300498	温氏股份	15,794,858.48	5.86
56	002405	四维图新	15,775,962.86	5.85
57	002511	中顺洁柔	15,659,815.57	5.81
58	300595	欧普康视	15,409,241.96	5.72
59	300679	电连技术	14,525,248.92	5.39
60	601939	建设银行	14,521,120.40	5.39
61	600837	海通证券	14,106,719.90	5.23
62	002180	纳思达	14,049,761.32	5.21
63	002212	南洋股份	13,825,400.00	5.13
64	300357	我武生物	13,410,459.49	4.97
65	000568	泸州老窖	12,917,424.64	4.79
66	300059	东方财富	12,754,093.00	4.73
67	000975	银泰黄金	12,699,374.54	4.71

68	002078	太阳纸业	11,721,196.88	4.35
69	002572	索菲亚	11,541,891.03	4.28
70	002821	凯莱英	11,179,585.13	4.15
71	002153	石基信息	10,915,639.27	4.05
72	603186	华正新材	10,649,775.00	3.95
73	601899	紫金矿业	10,517,916.00	3.90
74	601933	永辉超市	10,353,142.00	3.84
75	603043	广州酒家	10,191,211.90	3.78
76	600547	山东黄金	9,757,354.00	3.62
77	002812	恩捷股份	9,522,460.90	3.53
78	688166	博瑞医药	9,022,507.46	3.35
79	300001	特锐德	8,856,973.98	3.28
80	603859	能科股份	8,776,311.00	3.26
81	300601	康泰生物	8,626,355.80	3.20
82	000333	美的集团	8,552,397.01	3.17
83	600406	国电南瑞	8,522,439.96	3.16
84	600036	招商银行	8,166,176.73	3.03
85	600690	海尔智家	8,112,745.00	3.01
86	600588	用友网络	8,019,037.00	2.97
87	600521	华海药业	7,727,585.00	2.87
88	300347	泰格医药	7,649,053.12	2.84
89	601688	华泰证券	7,592,548.00	2.82
90	002796	世嘉科技	6,863,685.50	2.55
91	000538	云南白药	6,384,321.00	2.37
92	600486	扬农化工	6,309,045.04	2.34
93	300284	苏交科	6,292,781.00	2.33
94	300759	康龙化成	6,108,976.92	2.27
95	002281	光迅科技	6,037,874.66	2.24
96	000001	平安银行	6,029,383.39	2.24
97	603517	绝味食品	6,013,737.00	2.23
98	002223	鱼跃医疗	5,864,370.38	2.18

99	002841	视源股份	5,754,325.48	2.13
100	300575	中旗股份	5,652,688.74	2.10
101	601186	中国铁建	5,624,009.00	2.09
102	002304	洋河股份	5,574,118.80	2.07

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,042,350,787.08
卖出股票收入（成交）总额	3,929,869,671.21

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,951,567.00	0.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,218,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,169,567.00	0.70

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)

1	019611	19国债01	109,450	10,951,567.00	0.63
2	128085	鸿达转债	3,040	304,000.00	0.02
3	128084	木森转债	2,370	237,000.00	0.01
4	113029	明阳转债	1,890	189,000.00	0.01
5	128086	国轩转债	1,830	183,000.00	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	923,499.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	303,621.27

5	应收申购款	540,236.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,767,356.64

8.12.4 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。

8.12.5 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	688166	博瑞医药	206,171.24	0.01	新发流通受限

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
19,374	66,435.29	49,746,221.03	3.86%	1,237,371,106.82	96.14%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,610,920.39	0.13%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年04月02日)基金份额总额	569,838,633.50
本报告期期初基金份额总额	351,856,536.91
本报告期基金总申购份额	2,177,856,017.10
减：本报告期基金总赎回份额	1,242,595,226.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,287,117,327.85

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，2019年11月6日，钱慧同志因公司安排离任合规负责人兼首席风险官，基金管理人聘任刘泉同志为合规负责人兼首席风险官，聘任孔朱亮同志为首席信息官；2019年11月27日，李红芸同志因个人原因，离任公司副总经理、财务负责人、董事会秘书，基金管理人聘任刘泉同志为董事会秘书，由钱慧同志代任财务负责人。无基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为40,000.00元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	1,056,088,335.07	11.80%	772,308.48	14.29%	-
长江证券	1	747,252,367.04	8.35%	546,492.93	10.11%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	592,810,790.92	6.62%	433,616.68	8.02%	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-

海通证券	1	315,141,833.48	3.52%	230,472.02	4.26%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	267,865,883.80	2.99%	195,890.73	3.62%	-
天风证券	1	306,984,671.80	3.43%	224,500.97	4.15%	-
西部证券	1	277,218,277.07	3.10%	202,728.70	3.75%	-
兴业证券	1	101,287,565.96	1.13%	74,068.06	1.37%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	315,010,075.62	3.52%	230,396.21	4.26%	-
财通证券	2	4,972,222,469.46	55.54%	2,495,365.19	46.16%	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	2,003,395.68	3.31%	-	-	-	-	-	-

长江证券	524,060.62	0.87%	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	1,536,341.93	2.54%	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	209,055.00	0.35%	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	73,146.00	0.12%	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	491,902.20	0.81%	-	-	-	-	-	-
财通证券	55,632,625.43	92.00%	369,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

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、个股分析的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.本基金本报告期新增安信证券、中信证券、东吴证券、国泰君安证券、海通证券公司的交易单元各1个。

d.由于四舍五入的原因，成交金额占当期债券回购成交总额的比例的分项之和与合计可能有尾差。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	中国证券报、管理人网站(www.ctzg.com)	2019-01-28
2	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加凤凰金信（银川）基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-01-31
3	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加乾道盈泰基金销售（北京）有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-01-31
4	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-01-31
5	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加沈阳麟龙投资顾问有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-02-25

6	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加奕丰基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-02-26
7	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加民商基金销售(上海)有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-03-14
8	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加扬州国信嘉利基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-03-27
9	财通证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行费率优惠活动的公告	同上	2019-03-30
10	关于财通证券资产管理有限公司在直销渠道开展开放式基金认申购费率优惠活动的公告	同上	2019-04-13
11	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海联泰基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-04-25
12	财通证券资产管理有限公司关于在网上直销渠道开通基金转换业务及费率优惠活动的公告	同上	2019-04-29
13	财通证券资产管理有限公司关于在网上直销渠道开通基	同上	2019-04-29

	金定期定额投资业务及费率优惠活动的公告		
14	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-05-13
15	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要-2019年第1号	同上	2019-05-16
16	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）-2019年第1号	同上	2019-05-16
17	财通证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购、定期定额投资最低金额限制的公告	同上	2019-06-06
18	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-06-10
19	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	同上	2019-06-12
20	财通证券资产管理有限公司关于旗下公募基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	同上	2019-06-20
21	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海陆金所基金销售有限公司为	同上	2019-07-15

	销售机构并新增定期定额投资业务的公告		
22	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-07-19
23	财通证券资产管理有限公司关于在网上直销交易平台开通赎回转购业务及费率优惠活动的公告	同上	2019-07-22
24	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金开放日常转换业务公告	同上	2019-07-22
25	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为销售机构的公告	同上	2019-08-02
26	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海财咖啡基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-08-12
27	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-08-26
28	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加深圳信诚基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-09-09
29	关于财通证券资产管理有限	同上	2019-09-09

	公司旗下部分基金在德邦证券股份有限公司开通定投业务的公告		
30	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为销售机构并新增定期定额投资业务的公告	同上	2019-09-23
31	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在百度百盈新增定期定额投资业务并参加费率优惠的公告	同上	2019-10-17
32	财通证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2019-11-07
33	财通证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告(首席信息官）	同上	2019-11-07
34	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在大连网金新增定期定额投资业务并参加费率优惠的公告	同上	2019-11-07
35	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）-2019年第2号	同上	2019-11-22
36	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议	同上	2019-11-22
37	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同	同上	2019-11-22
38	财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要-2019年第	同上	2019-11-22

	2号		
39	关于财通证券资产管理有限公司旗下15只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的提示性公告	同上	2019-11-22
40	财通证券资产管理有限公司2019年行业高级管理人员变更公告	同上	2019-11-28
41	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在申万宏源等销售机构新增定期定额投资业务并参与费率优惠的公告	同上	2019-12-27

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、财通资管消费精选灵活配置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、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议
4、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同
5、财通资管消费精选灵活配置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

13.2 存放地点

上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

13.3 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

财通证券资产管理有限公司

二〇二〇年三月二十七日