

融通产业趋势精选混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通产业趋势精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同约定，于 2026 年 8 月 13 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人及基金托管人	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
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 盈利投资者数量占比	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通产业趋势精选混合型证券投资基金	
基金简称	融通产业趋势精选混合	
基金主代码	011011	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 16 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
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	509,813,977.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通产业趋势精选混合 A	融通产业趋势精选混合 C
下属分级基金的交易代码	011011	019194
报告期末下属分级基金的份额总额	188,918,664.56 份	320,895,312.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，深入研究产业发展趋势，精选优势行业的优质个股进行中长期投资，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略（产业趋势投资策略、港股通标的股票的投资策略、新三板精选层股票投资策略、存托凭证的投资策略）、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×45%+中证香港 100 指数收益率×20%+中国战略新兴产业成份指数收益率×5%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 本基金可投资新三板精选层股票，会面临参与新三板精选层股票交易产生的公司风险、流动性风险、信息风险等特有风险。

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		融通基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	方毅祖	任航
	联系电话	(0755) 26948666	010-66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95599
传真		(0755) 26935005	010-68121816
注册地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

	层、42 层	
邮政编码	518054	100031
法定代表人	张威	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	融通产业趋势精选混合 A	融通产业趋势精选混合 C
本期已实现收益	-3,044,945.71	-10,834,931.79
本期利润	-5,251,872.42	-32,391,255.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0272	-0.1082
本期加权平均净值利润率	-2.17%	-8.73%
本期基金份额净值增长率	6.95%	6.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-11,628,278.06	-25,312,980.66
期末可供分配基金份额利润	-0.0616	-0.0789
期末基金资产净值	224,070,045.25	374,413,087.12
期末基金份额净值	1.1861	1.1668
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	18.61%	84.31%

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、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配

利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

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

融通产业趋势精选混合 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
过去三个月	-2.91%	1.81%	6.19%	0.82%	-9.10%	0.99%
过去六个月	6.95%	1.91%	2.87%	0.77%	4.08%	1.14%
过去一年	57.87%	1.73%	14.27%	0.71%	43.60%	1.02%
过去三年	78.01%	1.38%	23.78%	0.78%	54.23%	0.60%
过去五年	13.20%	1.41%	-0.48%	0.80%	13.68%	0.61%
自基金合同生效起至今	18.61%	1.39%	2.19%	0.80%	16.42%	0.59%

融通产业趋势精选混合 C

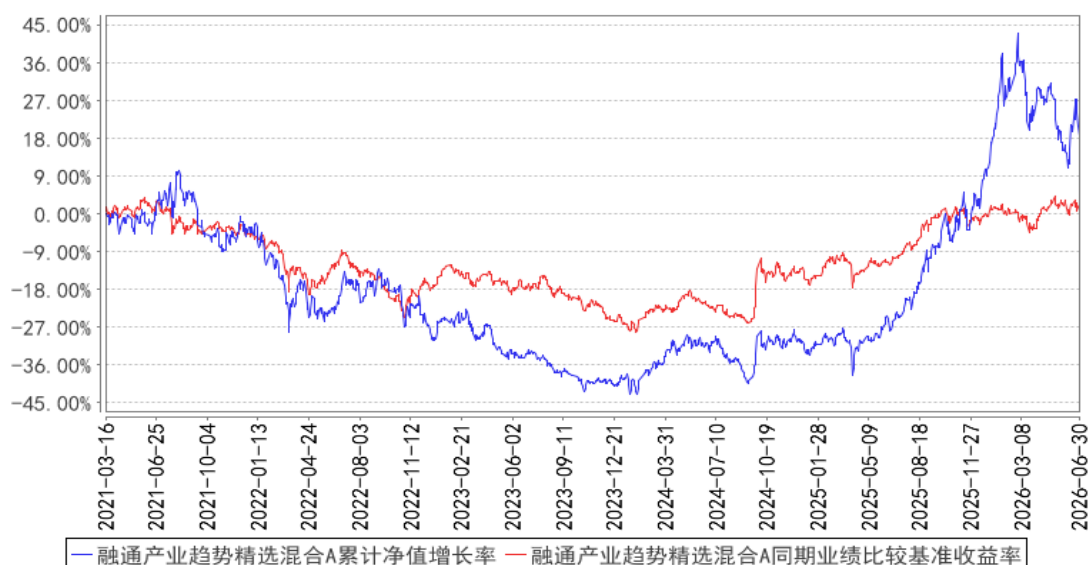
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.05%	1.81%	6.19%	0.82%	-9.24%	0.99%
过去六个月	6.65%	1.91%	2.87%	0.77%	3.78%	1.14%
过去一年	56.93%	1.73%	14.27%	0.71%	42.66%	1.02%
自基金合同生效起至今	84.31%	1.41%	26.18%	0.78%	58.13%	0.63%

注：1、本基金于2023年8月22日增设C类份额，该类份额首次确认日为2023年8月23日。

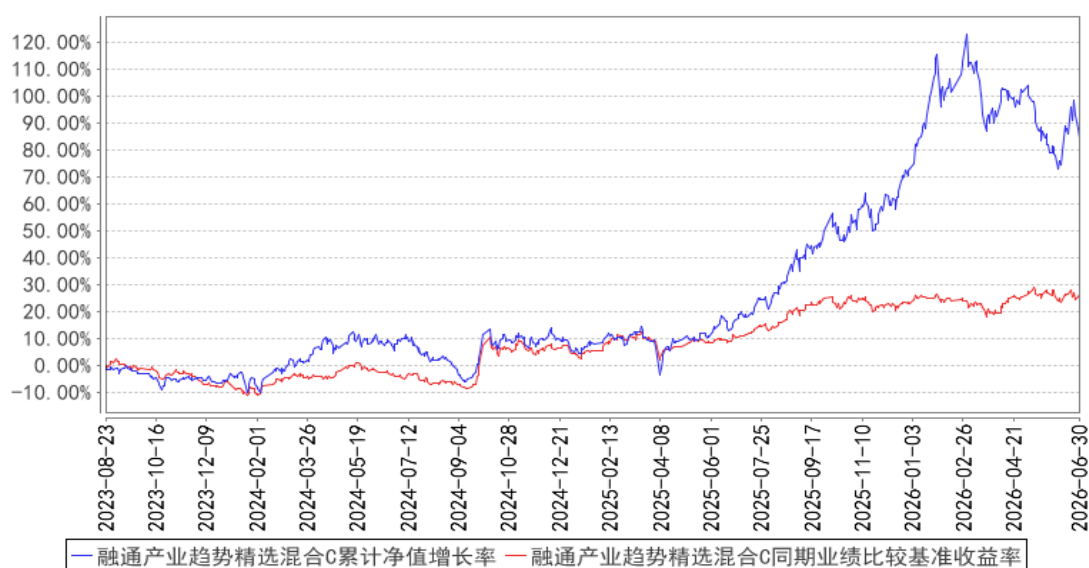
2、本基金于2026年6月26日发布公告，基金管理人决定自2026年7月27日起调整本基金的业绩比较基准，调整后的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中证港股通综合指数（港元）收益率×20%+中债-综合全价（总值）指数收益率×10%。

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

融通产业趋势精选混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通产业趋势精选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于2023年8月22日增设C类份额，该类份额首次确认日为2023年8月23日，故本基金C类份额的统计区间为2023年8月23日至本报告期末。

3.3 其他指标

无。

§ 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

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：诚通证券股份有限公司 60%、奥明资产管理有限公司（Amova Asset Management Co., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII 基金等。

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		
李文海	本基金的基金经理	2023 年 5 月 9 日	-	9 年	李文海先生，清华大学理学硕士，9 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2017 年 7 月加入融通基金管理有限公司，曾任行业研究员。现任融通产业趋势精选混合型证券投资基金基金经理、融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新材料混合型发起式证券投资基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、

交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

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

上半年 A 股市场行情分化特征十分显著。一季度顺周期标的表现出色，而进入二季度一方面，受霍尔木兹海峡通行态势反复、恢复进度不及预期影响，市场担忧油价上行进而引发滞胀压力，内外需导向的传统产业板块以及港股互联网板块持续震荡调整；另一方面，AI 领域资本开支持续超出市场预期，AI 基建产业景气度持续攀升，顺势带动 AI 算力、半导体、PCB 等上下游产业链个股行情大幅走高。

本基金在一季度重点持仓顺周期化工、有色板块，二季度调整持仓结构，逐步减持受传统经济周期影响较深、估值及股价处于相对高位的有色、油运等板块，同时适度增配 AI 产业链相关标的，重点布局供给格局偏紧、有望受益行业景气与涨价逻辑的 PCB 上游材料，此外同步优化调整化工板块内部持仓结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通产业趋势精选混合 A 基金份额净值为 1.1861 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.87%；

截至本报告期末融通产业趋势精选混合 C 基金份额净值为 1.1668 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.65%，同期业绩比较基准收益率为 2.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年市场行情演绎相对比较极致，AI 为代表的硬科技行情一枝独秀，市场持仓集中度达到近些年的极值，我们认为尽管科技上半年的景气度确实相对其他行业更加突出，但是在我国经济逐步企稳回暖的状态下，当下其他行业的估值性价比已经逐渐展示出来，二季度如化工、有色以及部分消费实际上都展现了较好的盈利弹性，下半年市场有可能围绕这些行业展开在平衡配置。

现阶段本基金核心持仓主要聚焦三大方向：

第一，化工行业。经历前期市场回调后，化工板块投资价值进一步凸显，行业长期供给收缩

的核心逻辑并未发生改变，成长空间充足；短期受行业传统淡季、海峡局势扰动推升原材料价格影响，行业基本面环比有所承压。展望后市，随着海峡通行逐步恢复，叠加行业传统旺季来临、下游企业补库需求释放，化工行业基本面有望迎来持续环比改善。

第二，AI 产业链上游材料，涵盖 PCB 配套材料、光模块原材料等。AI 基建产业落地节奏持续超预期，电子布、铜箔、钻针等 PCB 核心上游材料受制于供给紧缺，产品价格存在超预期上涨空间。

第三，油运板块。年初行业新增运力入局后，油运运价稳步上行，行业运力供给偏紧的格局已然明朗。后续若霍尔木兹海峡通行恢复正常，或将掀起原油抢运热潮，进而推动油运运价再度上行，板块具备较强行情催化潜力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金不存在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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对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、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通产业趋势精选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	27,319,410.14	11,307,328.25
结算备付金		10,150,457.76	1,968,750.67
存出保证金		435,320.39	204,605.26
交易性金融资产	6.4.7.2	572,840,560.44	219,988,177.06
其中：股票投资		557,283,390.03	218,068,993.83
基金投资		—	—
债券投资		15,557,170.41	1,919,183.23
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		3,265,537.99	636,271.66
应收股利		96,009.64	168.00
应收申购款		241,862.99	235,007.09
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		614,349,159.35	234,340,307.99
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		12,022,967.41	1,723,908.79
应付赎回款		1,604,220.84	1,521,945.99
应付管理人报酬		593,055.03	232,266.36
应付托管费		98,842.49	38,711.07
应付销售服务费		180,280.63	42,118.45
应付投资顾问费		—	—
应交税费		533.09	16.38
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.9	1,366,127.49	608,172.92
负债合计		15,866,026.98	4,167,139.96
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	509,813,977.29	208,648,948.46
其他综合收益	6.4.7.11	—	—
未分配利润	6.4.7.12	88,669,155.08	21,524,219.57
净资产合计		598,483,132.37	230,173,168.03
负债和净资产总计		614,349,159.35	234,340,307.99

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，融通产业趋势精选混合 A 类基金份额净值 1.1861 元，基金份额总额 188,918,664.56 份；融通产业趋势精选混合 C 类基金份额净值 1.1668 元，基金份额总额 320,895,312.73 份；总份额合计 509,813,977.29 份。

6.2 利润表

会计主体：融通产业趋势精选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-32,191,095.50	10,620,965.7

			3
1. 利息收入		101,813.11	40,262.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	101,813.11	40,262.70
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,095,806.00	2,922,300.34
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-12,669,547.49	2,009,866.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	32,074.49	14,269.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,541,667.00	898,164.94
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）	6.4.7.20	-23,763,250.38	7,591,475.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	566,147.77	66,927.12
减：二、营业总支出		5,452,032.38	1,870,914.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,641,841.00	1,330,696.16
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	606,973.48	221,782.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,099,100.23	222,602.76
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		94.97	-
8. 其他费用	6.4.7.23	104,022.70	95,833.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-37,643,127.88	8,750,051.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-37,643,127.88	8,750,051.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-37,643,127.88	8,750,051.04

6.3 净资产变动表

会计主体：融通产业趋势精选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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	208,648,948.46	-	21,524,219.57	230,173,168.03
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	208,648,948.46	-	21,524,219.57	230,173,168.03
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	301,165,028.83	-	67,144,935.51	368,309,964.34
(一)、综合收益总额	-	-	-37,643,127.88	-37,643,127.88
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数 (净资产减少以 “-”号填列)	301,165,028.83	-	104,788,063.39	405,953,092.22
其中：1. 基金申购款	680,993,375.04	-	185,615,802.71	866,609,177.75
2. 基金赎回款	-379,828,346.21	-	-80,827,739.32	-460,656,085.53
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的净资产变动(净资 产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	509,813,977.29	-	88,669,155.08	598,483,132.37
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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	502,678,103.55	-	-157,506,295.40	345,171,808.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	502,678,103.55	-	-157,506,295.40	345,171,808.15
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-291,342,985.66	-	104,768,991.19	-186,573,994.47
(一)、综合收益总额	-	-	8,750,051.04	8,750,051.04
(二)、本期基金份额 交易产生的净资产变	-291,342,985.66	-	96,018,940.15	-195,324,045.51

动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	8,981,484.99	-	-2,796,470.52	6,185,014.47
2. 基金赎回款	-300,324,470.65	-	98,815,410.67	-201,509,059.98
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	211,335,117.89	-	-52,737,304.21	158,597,813.68

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：

商小虎

高翔

郑刚

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

融通产业趋势精选混合型证券投资基金(原“融通产业趋势精选 2 年封闭运作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[2020]3225 号《关于准予融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通产业趋势精选 2 年封闭运作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基金,基金合同生效后两年内封闭运作,封闭运作期届满后转为开放式运作,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 377,169,209.87 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(2021)第 0318 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 377,380,676.72 份,其中认购资金利息折合 211,466.85 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》和《融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金基金合同生效后,设置一个两年的封闭运作期,为自基金合同生效之日起至两年后的年度对日的前一日止(如该日为非工作日或无对应日期,则顺延至下一工作日)。本基金在封闭运作期内不开放申购、赎回业务。本基金

封闭期自 2021 年 3 月 16 日至 2023 年 3 月 15 日止。根据基金管理人于 2023 年 3 月 14 日发布的《关于融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金封闭运作期届满转为开放式运作、变更基金名称并修订基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2023 年 3 月 16 日起转换为开放式运作，基金名称变更为“融通产业趋势精选混合型证券投资基金”，基金简称变更为“融通产业趋势精选混合”，基金代码不变，并适用基金合同中关于转为开放式运作后的有关规定。

根据《关于融通产业趋势精选混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》及修改后的《融通产业趋势精选混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金自 2023 年 8 月 22 日起增设 C 类基金份额。原在投资者申购时收取前端申购费用的份额，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额转为 A 类基金份额；不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 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并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通产业趋势精选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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、全国中小企业股份转让系统精选层挂牌股票(以下简称“新三板精选层股票”)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券及其他中国证监会允许投资的债券)、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、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票投资(含存托凭证)比例为基金资产的 60%-95%(其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%)，本基金投资于新三板精选层股票的市值不得超过基金资产净值的 15%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×45%+中证香港 100 指数收益率×20%+中国战略新兴产业成份指数收益率×5%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于本报告截止日的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债

券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

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

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

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

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	27,319,410.14
等于：本金	27,317,080.58
加：应计利息	2,329.56
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	27,319,410.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	548,586,754.58	-	557,283,390.03	8,696,635.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	15,417,659.00	15,557,170.41	-6,659.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	15,417,659.00	15,557,170.41	-6,659.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	564,004,413.58	146,170.41	572,840,560.44	8,689,976.45

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,139.31
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,274,136.90
其中：交易所市场	1,274,136.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,851.28
合计	1,366,127.49

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通产业趋势精选混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	127,413,091.65	127,413,091.65
本期申购	197,168,374.77	197,168,374.77
本期赎回（以“-”号填列）	-135,662,801.86	-135,662,801.86
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	188,918,664.56	188,918,664.56

融通产业趋势精选混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	81,235,856.81	81,235,856.81
本期申购	483,825,000.27	483,825,000.27
本期赎回（以“-”号填列）	-244,165,544.35	-244,165,544.35
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	320,895,312.73	320,895,312.73

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

融通产业趋势精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,811,731.14	23,696,374.02	13,884,642.88
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-9,811,731.14	23,696,374.02	13,884,642.88
本期利润	-3,044,945.71	-2,206,926.71	-5,251,872.42
本期基金份额交易产生的变动数	1,228,398.79	25,290,211.44	26,518,610.23
其中：基金申购款	379,330.89	60,217,525.98	60,596,856.87
基金赎回款	849,067.90	-34,927,314.54	-34,078,246.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,628,278.06	46,779,658.75	35,151,380.69

融通产业趋势精选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,365,660.07	15,005,236.76	7,639,576.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-7,365,660.07	15,005,236.76	7,639,576.69
本期利润	-10,834,931.79	-21,556,323.67	-32,391,255.46
本期基金份额交易产生的变动数	-7,112,388.80	85,381,841.96	78,269,453.16
其中：基金申购款	-10,350,960.61	135,369,906.45	125,018,945.84
基金赎回款	3,238,571.81	-49,988,064.49	-46,749,492.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,312,980.66	78,830,755.05	53,517,774.39

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	75,133.23
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	12,524.11
其他	14,155.77
合计	101,813.11

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,669,547.49
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-12,669,547.49

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	2,430,209,362.41
减：卖出股票成本总额	2,438,545,434.38
减：交易费用	4,333,475.52
买卖股票差价收入	-12,669,547.49

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	31,994.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	80.00
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	32,074.49

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,231,241.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,105,964.00
减：应计利息总额	125,197.10
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	80.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	3,541,667.00
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	3,541,667.00

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-23,763,250.38
股票投资	-23,756,057.38
债券投资	-7,193.00
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	-23,763,250.38

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	505,461.09
基金转换费收入	60,686.68
合计	566,147.77

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. 基金的转换费用包括转换费和补差费，其中不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	16,671.42

账户维护费	9,000.00
合计	104,022.70

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，本基金并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、关联关系

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

本报告期与本基金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
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	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（“中国农业银行”）	基金托管人、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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	3,641,841.00	1,330,696.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	874,229.75	401,464.58
应支付基金管理人的净管理费	2,767,611.25	929,231.58

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	606,973.48	221,782.73

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通产业趋势精选混合 A	融通产业趋势精选混合 C	合计
融通基金	-	488,116.91	488,116.91
合计	-	488,116.91	488,116.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通产业趋势精选混合 A	融通产业趋势精选混合 C	合计
融通基金	-	176,207.53	176,207.53
合计	-	176,207.53	176,207.53

注：销售服务费每日计提，按月支付。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年费率为 0.60%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 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	27,319,410.14	75,133.23	6,070,204.11	35,160.12

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 6 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	10.11	10.11	7,131	72,094.41	72,094.41	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.11	10.11	16,642	168,250.62	168,250.62	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.12	27.73	3,205	32,434.60	88,874.65	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	46.08	463.33	1,063	48,983.04	492,519.79	-
301669	高特电子	2026 年 6 月	1-6 个月 (含)	首发流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

		2 日								
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	69.66	160.06	650	45,279.00	104,039.00	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	21.93	77.78	171	3,750.03	13,300.38	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.18	17.59	208	2,325.44	3,658.72	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	21.88	25.52	74	1,619.12	1,888.48	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	6 个月以上	首发流通受限	29.06	48.56	4,032	117,169.92	195,793.92	-

		日								
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月以上	首发流通受限	22.68	42.16	6,245	141,636.60	263,289.20	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	6个月以上	首发流通受限	114.28	676.94	738	84,338.64	499,581.72	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	1-6个月(含)	首发流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	1-6个月(含)	首发流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026年4月1日	1-6个月(含)	首发流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	1-6个月(含)	首发流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	1-6个月(含)	首发流通受限	19.68	141.49	1,049	20,644.32	148,423.01	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股

票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，可能会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。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。本基金的基金管理人制定了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，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

本基金管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

在公司管理层下设立合规与风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标。

监察稽核相关部门负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式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。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2025 年 12 月 31 日：同）。

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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外（如有），本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	27,319,410.14	-	-	-	27,319,410.14
结算备付金	10,150,457.76	-	-	-	10,150,457.76
存出保证金	435,320.39	-	-	-	435,320.39
交易性金融资产	15,557,170.41	-	-	557,283,390.03	572,840,560.44
应收股利	-	-	-	96,009.64	96,009.64
应收申购款	-	-	-	241,862.99	241,862.99
应收清算款	-	-	-	3,265,537.99	3,265,537.99
资产总计	53,462,358.70	-	-	560,886,800.65	614,349,159.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,604,220.84	1,604,220.84
应付管理人报酬	-	-	-	593,055.03	593,055.03
应付托管费	-	-	-	98,842.49	98,842.49
应付清算款	-	-	-	12,022,967.41	12,022,967.41
应付销售服务费	-	-	-	180,280.63	180,280.63
应交税费	-	-	-	533.09	533.09
其他负债	-	-	-	1,366,127.49	1,366,127.49
负债总计	-	-	-	15,866,026.98	15,866,026.98
利率敏感度缺口	53,462,358.70	-	-	545,020,773.67	598,483,132.37
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,307,328.25	-	-	-	11,307,328.25
结算备付金	1,968,750.67	-	-	-	1,968,750.67
存出保证金	204,605.26	-	-	-	204,605.26
交易性金融资产	1,919,183.23	-	-	218,068,993.83	219,988,177.06
应收股利	-	-	-	168.00	168.00
应收申购款	-	-	-	235,007.09	235,007.09
应收清算款	-	-	-	636,271.66	636,271.66
资产总计	15,399,867.41	-	-	218,940,440.58	234,340,307.99

负债					
应付赎回款	-	-	-	1,521,945.99	1,521,945.99
应付管理人报酬	-	-	-	232,266.36	232,266.36
应付托管费	-	-	-	38,711.07	38,711.07
应付清算款	-	-	-	1,723,908.79	1,723,908.79
应付销售服务费	-	-	-	42,118.45	42,118.45
应交税费	-	-	-	16.38	16.38
其他负债	-	-	-	608,172.92	608,172.92
负债总计	-	-	-	4,167,139.96	4,167,139.96
利率敏感度缺口	15,399,867.41	-	-	-214,773,300.62	230,173,168.03

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 2026 年 6 月 30 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 2.60%（2025 年 12 月 31 日：0.83%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	45,849,078.20	-	45,849,078.20
资产合计	-	45,849,078.20	-	45,849,078.20
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	45,849,078.20	-	45,849,078.20
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	46,765,299.37	-	46,765,299.37
资产合计	-	46,765,299.37	-	46,765,299.37
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	46,765,299.37	-	46,765,299.37

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	2,292,453.91	2,338,264.97
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-2,292,453.91	-2,338,264.97

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。在封闭运作期内，股票投资(含存托凭证)比例为基金资产的 60%-100%(其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%)，本基金投资于新三板精选层股票的市值不得超过基金资产净值的 20%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；封闭期届满转型后，股票投资(含存托凭证)比例为基金资产的 60%-95%(其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%)，本基金投资于新三板精选层股票的市值不得超过基金资产净值的 15%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	557,283,390.03	93.12	218,068,993.83	94.74
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	557,283,390.03	93.12	218,068,993.83	94.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数收益率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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数收益率上升 5%	32,348,740.23	13,533,272.68
	2. 沪深 300 指数收益率下降 5%	-32,348,740.23	-13,533,272.68

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	554,540,343.46	217,303,309.37
第二层次	15,797,515.44	1,919,183.23
第三层次	2,502,701.54	765,684.46
合计	572,840,560.44	219,988,177.06

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	557,283,390.03	90.71
	其中：股票	557,283,390.03	90.71
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	15,557,170.41	2.53
	其中：债券	15,557,170.41	2.53
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—

7	银行存款和结算备付金合计	37,469,867.90	6.10
8	其他各项资产	4,038,731.01	0.66
9	合计	614,349,159.35	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 45,849,078.20 元，占基金资产净值比例为 7.66%。

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

金额单位：人民币元

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	35,646.00	0.01
B	采矿业	88,309.22	0.01
C	制造业	463,504,312.42	77.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,146,042.87	0.69
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	3,006,192.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	26,567,459.14	4.44
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,968,977.50	1.83
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	3,117,372.68	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
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	511,434,311.83	85.46

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	—	—
能源	—	—
材料	37,169,258.52	6.21
工业	7,932,171.84	1.33
非必需消费品	—	—
必需消费品	—	—
医疗保健	—	—
金融	—	—
科技	747,647.84	0.12

通讯	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	45,849,078.20	7.66

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

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	01888	建滔积层板	377,000	32,466,008.15	5.42
2	601233	桐昆股份	1,461,100	31,632,815.00	5.29
3	603225	新凤鸣	1,529,958	30,063,674.70	5.02
4	000703	恒逸石化	1,990,300	27,008,371.00	4.51
5	002001	新 和 成	887,736	25,229,457.12	4.22
6	600309	万华化学	347,100	23,745,111.00	3.97
7	603379	三美股份	300,700	22,820,123.00	3.81
8	600549	厦门钨业	267,000	22,748,400.00	3.80
9	601872	招商轮船	1,269,724	22,309,050.68	3.73
10	688146	中船特气	59,159	20,705,058.41	3.46
11	002552	宝鼎科技	324,900	19,818,900.00	3.31
12	002493	荣盛石化	1,716,800	18,455,600.00	3.08
13	600426	华鲁恒升	648,700	15,516,904.00	2.59
14	603268	松发股份	109,300	15,223,304.00	2.54
15	000949	新乡化纤	2,111,400	13,386,276.00	2.24
16	688777	中控技术	93,353	10,968,977.50	1.83
17	600409	三友化工	1,664,300	10,168,873.00	1.70
18	603663	三祥新材	97,500	9,389,250.00	1.57
19	000830	鲁西化工	712,600	8,551,200.00	1.43
20	600160	巨化股份	159,400	8,449,794.00	1.41
21	002636	金安国纪	69,237	8,306,362.89	1.39
22	600141	兴发集团	175,900	8,262,023.00	1.38
23	300776	帝尔激光	33,900	7,287,144.00	1.22
24	601208	东材科技	95,200	6,739,208.00	1.13
25	688549	中巨芯	182,330	6,711,567.30	1.12
26	603186	华正新材	29,000	6,533,700.00	1.09
27	300806	斯迪克	58,200	6,518,400.00	1.09
28	002258	利尔化学	499,400	6,347,374.00	1.06
29	01138	中远海能	526,000	6,318,336.46	1.06
30	600389	江山股份	317,175	6,191,256.00	1.03
31	600078	澄星股份	377,900	5,369,959.00	0.90
32	000510	新金路	212,300	5,273,532.00	0.88
33	600346	恒力石化	278,400	4,930,464.00	0.82
34	601058	赛轮轮胎	368,700	4,251,111.00	0.71

35	00148	建滔集团	40,000	4,096,081.80	0.68
36	603393	新天然气	182,424	3,905,697.84	0.65
37	603260	合盛硅业	79,700	3,846,322.00	0.64
38	002068	黑猫股份	251,400	3,778,542.00	0.63
39	300596	利安隆	69,600	3,652,608.00	0.61
40	000657	中钨高新	36,900	3,532,068.00	0.59
41	601677	明泰铝业	205,600	3,412,960.00	0.57
42	605366	宏柏新材	259,200	3,377,376.00	0.56
43	000811	冰轮环境	56,400	3,170,808.00	0.53
44	603259	药明康德	24,800	3,087,848.00	0.52
45	600397	江钨装备	110,400	3,006,192.00	0.50
46	002484	江海股份	24,800	2,604,000.00	0.44
47	002928	华夏航空	368,700	2,577,213.00	0.43
48	600458	时代新材	152,500	2,523,875.00	0.42
49	300321	同大股份	38,500	2,478,630.00	0.41
50	002080	中材科技	23,700	2,133,000.00	0.36
51	300136	信维通信	16,700	1,991,475.00	0.33
52	603989	艾华集团	35,000	1,837,500.00	0.31
53	688180	君实生物	53,156	1,797,735.92	0.30
54	688025	杰普特	3,823	1,796,810.00	0.30
55	603713	密尔克卫	23,600	1,679,612.00	0.28
56	00670	中国东方航空股份	588,000	1,613,835.38	0.27
57	300236	上海新阳	10,800	1,420,200.00	0.24
58	600888	新疆众和	83,000	1,318,870.00	0.22
59	605111	新洁能	12,700	1,259,078.00	0.21
60	002056	横店东磁	41,000	1,249,680.00	0.21
61	300566	激智科技	33,700	1,245,215.00	0.21
62	688200	华峰测控	2,303	1,209,305.30	0.20
63	603078	江化微	24,300	1,200,906.00	0.20
64	002008	大族激光	7,700	1,155,847.00	0.19
65	300401	花园生物	46,100	1,009,129.00	0.17
66	688630	芯碁微装	1,715	942,203.85	0.16
67	01347	华虹宏力	4,000	747,647.84	0.12
68	03939	万国黄金集团	84,000	567,614.80	0.09
69	600075	新疆天业	133,600	539,744.00	0.09
70	688795	摩尔线程	738	499,581.72	0.08
71	301666	大普微	1,063	492,519.79	0.08
72	300522	世名科技	12,500	299,625.00	0.05
73	688781	视涯科技	6,245	263,289.20	0.04
74	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.04
75	001248	华润新能源	23,773	240,345.03	0.04
76	688765	禾元生物	4,032	195,793.92	0.03
77	688802	沐曦股份	233	192,993.90	0.03

78	688820	盛合晶微	1,049	148,423.01	0.02
79	301682	宏明电子	650	104,039.00	0.02
80	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
81	603345	安井食品	1,200	96,228.00	0.02
82	001399	惠科股份	3,205	88,874.65	0.01
83	300821	东岳硅材	2,900	59,624.00	0.01
84	301013	利和兴	800	57,800.00	0.01
85	603087	甘李药业	1,000	56,760.00	0.01
86	002539	云图控股	4,900	55,468.00	0.01
87	001280	中国铀业	782	52,159.40	0.01
88	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
89	03993	洛阳钼业	3,000	39,553.77	0.01
90	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
91	688759	必贝特	1,172	37,480.56	0.01
92	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
93	300970	华绿生物	1,950	35,646.00	0.01
94	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
95	301607	富特科技	504	26,334.00	0.00
96	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
97	688796	百奥赛图	192	21,004.80	0.00
98	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
99	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
100	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
101	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
102	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
103	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
104	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
105	301687	新广益	171	13,300.38	0.00
106	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
107	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
108	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00
109	301319	唯特偶	64	10,709.12	0.00
110	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
111	920098	科隆新材	400	7,208.00	0.00
112	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
113	301449	天溯计量	157	6,075.90	0.00
114	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
115	001369	双欣材料	359	4,853.68	0.00
116	603248	锡华科技	201	4,239.09	0.00
117	601112	振石股份	208	3,658.72	0.00
118	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
119	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
120	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00

121	603352	至信股份	74	1,888.48	0.00
122	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
123	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	000510	新金路	41,981,163.00	18.24
2	300806	斯迪克	39,859,394.00	17.32
3	601872	招商轮船	39,152,591.55	17.01
4	603268	松发股份	37,458,138.00	16.27
5	600309	万华化学	36,777,240.00	15.98
6	002001	新 和 成	36,769,197.02	15.97
7	601233	桐昆股份	36,742,156.98	15.96
8	000949	新乡化纤	34,684,723.00	15.07
9	000807	云铝股份	32,994,557.00	14.33
10	600176	中国巨石	32,983,716.51	14.33
11	01818	招金矿业	32,894,709.15	14.29
12	600346	恒力石化	32,150,837.00	13.97
13	002648	卫星化学	32,035,361.04	13.92
14	601600	中国铝业	29,011,684.00	12.60
14	02600	中国铝业	2,873,730.09	1.25
15	002532	天山铝业	31,679,558.66	13.76
16	01138	中远海能	30,864,414.88	13.41
17	603225	新凤鸣	29,297,305.67	12.73
18	002493	荣盛石化	28,469,205.18	12.37
19	603393	新天然气	28,384,013.50	12.33
20	600075	新疆天业	28,361,783.27	12.32
21	01787	山东黄金	25,773,122.33	11.20
21	600547	山东黄金	1,046,128.50	0.45
22	301239	普瑞眼科	26,702,321.05	11.60
23	000703	恒逸石化	26,601,232.36	11.56
24	600426	华鲁恒升	26,247,831.10	11.40
25	600875	东方电气	21,604,046.42	9.39
25	01072	东方电气	3,312,610.69	1.44
26	688059	华锐精密	24,541,980.02	10.66
27	002092	中泰化学	23,806,033.00	10.34
28	002552	宝鼎科技	23,723,462.00	10.31
29	000811	冰轮环境	23,433,584.91	10.18
30	300432	富临精工	23,404,924.00	10.17
31	600389	江山股份	23,101,387.15	10.04
32	601208	东材科技	22,188,371.40	9.64
33	06693	赤峰黄金	21,124,756.19	9.18

33	600988	赤峰黄金	783,227.00	0.34
34	01888	建滔积层板	21,206,488.64	9.21
35	09926	康方生物	21,080,015.57	9.16
36	603379	三美股份	20,522,617.98	8.92
37	002545	东方铁塔	20,417,365.00	8.87
38	000683	博源化工	19,456,581.00	8.45
39	600549	厦门钨业	19,349,739.00	8.41
40	00670	中国东方航空股份	18,956,951.13	8.24
41	603163	圣晖集成	18,819,365.75	8.18
42	600219	南山铝业	18,793,220.50	8.16
43	603281	江瀚新材	18,560,751.00	8.06
44	300774	倍杰特	18,125,057.90	7.87
45	002159	三特索道	17,613,873.50	7.65
46	002080	中材科技	17,562,514.60	7.63
47	688106	金宏气体	17,422,313.51	7.57
48	000830	鲁西化工	17,349,021.00	7.54
49	600603	广汇物流	16,457,854.00	7.15
50	603867	新化股份	16,239,900.64	7.06
51	600299	安迪苏	16,078,824.72	6.99
52	01171	兖矿能源	10,230,130.12	4.44
52	600188	兖矿能源	5,806,998.00	2.52
53	000975	山金国际	15,540,592.76	6.75
54	00883	中国海洋石油	12,286,741.29	5.34
54	600938	中国海油	2,798,552.00	1.22
55	605090	九丰能源	15,082,790.90	6.55
56	601899	紫金矿业	14,223,332.00	6.18
56	02899	紫金矿业	652,665.26	0.28
57	600759	ST 洲际	14,616,077.00	6.35
58	688146	中船特气	14,373,891.42	6.24
59	600397	江钨装备	13,792,504.00	5.99
60	600352	浙江龙盛	13,628,760.00	5.92
61	002258	利尔化学	12,955,743.00	5.63
62	601168	西部矿业	12,749,293.00	5.54
63	301511	德福科技	12,658,604.00	5.50
64	688008	澜起科技	12,568,577.71	5.46
65	300596	利安隆	12,447,268.00	5.41
66	600409	三友化工	12,446,742.00	5.41
67	605589	圣泉集团	12,261,879.00	5.33
68	603737	三棵树	12,234,479.84	5.32
69	300835	龙磁科技	12,100,565.00	5.26
70	600233	圆通速递	11,981,911.00	5.21
71	001203	大中矿业	11,929,859.00	5.18

72	603929	亚翔集成	11,810,816.00	5.13
73	605376	博迁新材	11,791,442.00	5.12
74	000408	藏格矿业	11,780,285.00	5.12
75	002475	立讯精密	11,505,779.00	5.00
76	603259	药明康德	11,358,116.00	4.93
77	600141	兴发集团	11,290,573.00	4.91
78	688301	奕瑞科技	11,166,833.58	4.85
79	688777	中控技术	11,053,257.58	4.80
80	688196	卓越新能	10,989,502.94	4.77
81	688257	新锐股份	10,653,128.28	4.63
82	603186	华正新材	10,616,410.00	4.61
83	600955	维远股份	10,600,920.00	4.61
84	002455	百川股份	10,549,543.43	4.58
85	000039	中集集团	10,544,239.90	4.58
86	300308	中际旭创	10,537,627.00	4.58
87	000657	中钨高新	10,294,414.00	4.47
88	600989	宝丰能源	10,260,762.00	4.46
89	002683	广东宏大	10,129,847.00	4.40
90	688268	华特气体	10,070,304.18	4.38
91	300776	帝尔激光	9,934,259.00	4.32
92	000951	中国重汽	9,877,061.28	4.29
93	300037	新宙邦	9,711,908.00	4.22
94	600256	广汇能源	9,686,023.00	4.21
95	600160	巨化股份	9,662,453.00	4.20
96	600623	华谊集团	9,583,634.00	4.16
97	603115	海星股份	9,553,687.00	4.15
98	920438	戈碧迦	9,485,368.10	4.12
99	603162	海通发展	9,346,701.72	4.06
100	603979	金诚信	9,166,851.42	3.98
101	600754	锦江酒店	8,772,171.00	3.81
102	000422	湖北宜化	8,703,898.00	3.78
103	03939	万国黄金集团	8,567,689.55	3.72
104	600452	涪陵电力	8,544,659.65	3.71
105	300390	天华新能	8,535,519.00	3.71
106	00753	中国国航	8,312,237.11	3.61
107	600338	西藏珠峰	7,968,847.00	3.46
108	603663	三祥新材	7,811,849.00	3.39
109	000506	招金黄金	7,601,915.00	3.30
110	688548	广钢气体	7,584,336.19	3.30
111	000990	诚志股份	7,527,694.00	3.27
112	300821	东岳硅材	7,492,052.00	3.25
113	09699	顺丰同城	7,466,563.06	3.24
114	002928	华夏航空	7,442,245.00	3.23

115	002636	金安国纪	7,415,504.82	3.22
116	600499	科达制造	7,402,486.00	3.22
117	603806	福斯特	7,234,223.00	3.14
118	002734	利民股份	7,174,486.00	3.12
119	601139	深圳燃气	7,093,832.30	3.08
120	301526	国际复材	6,873,707.00	2.99
121	600328	中盐化工	6,803,233.40	2.96
122	301217	铜冠铜箔	6,787,046.00	2.95
123	600183	生益科技	6,646,338.00	2.89
124	000688	国城矿业	6,542,421.00	2.84
125	300857	协创数据	6,500,694.20	2.82
126	002240	盛新锂能	6,380,107.00	2.77
127	000960	锡业股份	6,375,209.00	2.77
128	688697	纽威数控	6,337,633.64	2.75
129	603612	索通发展	6,307,652.00	2.74
130	603260	合盛硅业	6,268,510.00	2.72
131	601001	晋控煤业	6,234,851.79	2.71
132	002384	东山精密	6,198,929.00	2.69
133	601619	嘉泽新能	6,143,643.00	2.67
134	601677	明泰铝业	6,124,125.00	2.66
135	002237	恒邦股份	6,091,075.00	2.65
136	300483	首华燃气	6,066,665.00	2.64
137	688549	中巨芯	5,994,741.49	2.60
138	688625	呈和科技	5,966,683.70	2.59
139	301338	凯格精机	5,942,627.80	2.58
140	03808	中国重汽	5,878,810.04	2.55
141	600746	江苏索普	5,836,757.90	2.54
142	300819	聚杰微纤	5,779,176.00	2.51
143	603217	元利科技	5,732,221.20	2.49
144	002155	湖南黄金	5,727,423.00	2.49
145	09858	优然牧业	5,665,529.20	2.46
146	600458	时代新材	5,548,696.00	2.41
147	301319	唯特偶	5,542,391.43	2.41
148	600323	瀚蓝环境	5,464,276.00	2.37
149	600078	澄星股份	5,377,514.00	2.34
150	600882	妙可蓝多	5,375,449.80	2.34
151	600378	昊华科技	5,351,380.00	2.32
152	06869	长飞光纤光 缆	5,316,622.81	2.31
153	600595	中孚实业	5,248,070.00	2.28
154	600552	凯盛科技	5,207,023.43	2.26
155	000973	佛塑科技	5,137,587.00	2.23
156	01258	中国有色矿 业	5,113,526.87	2.22

157	02099	中国黄金国际	5,089,028.10	2.21
158	603227	雪峰科技	5,071,658.00	2.20
159	301345	涛涛车业	5,014,929.00	2.18
160	002468	申通快递	4,947,574.62	2.15
161	603619	中曼石油	4,947,055.00	2.15
162	603688	石英股份	4,878,954.50	2.12
163	002627	三峡旅游	4,779,038.35	2.08
164	000933	神火股份	4,719,633.00	2.05
165	000525	红太阳	4,685,584.00	2.04
166	300174	元力股份	4,636,299.00	2.01
167	600025	华能水电	4,619,327.00	2.01
168	603011	合锻智能	4,605,623.00	2.00

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	300806	斯迪克	47,743,378.00	20.74
2	000510	新金路	46,105,624.00	20.03
3	600176	中国巨石	41,356,167.72	17.97
4	000807	云铝股份	35,730,950.09	15.52
5	002648	卫星化学	32,172,200.00	13.98
6	01138	中远海能	31,223,209.67	13.57
7	601600	中国铝业	26,912,672.28	11.69
7	02600	中国铝业	3,194,538.33	1.39
8	603268	松发股份	29,645,032.00	12.88
9	002532	天山铝业	28,890,903.00	12.55
10	600346	恒力石化	27,457,615.00	11.93
11	01787	山东黄金	26,090,749.74	11.34
11	600547	山东黄金	944,424.00	0.41
12	603163	圣晖集成	26,609,710.00	11.56
13	601899	紫金矿业	25,754,530.00	11.19
13	02899	紫金矿业	710,213.27	0.31
14	301239	普瑞眼科	26,345,365.32	11.45
15	688059	华锐精密	25,341,782.49	11.01
16	06693	赤峰黄金	16,046,818.92	6.97
16	600988	赤峰黄金	9,267,948.00	4.03
17	300432	富临精工	25,272,669.00	10.98
18	600875	东方电气	22,199,807.12	9.64
18	01072	东方电气	3,054,162.52	1.33
19	002545	东方铁塔	24,857,153.00	10.80
20	600759	ST 洲际	24,616,650.00	10.69
21	01818	招金矿业	23,733,266.56	10.31

22	000975	山金国际	23,097,472.00	10.03
23	600075	新疆天业	21,960,283.20	9.54
24	000811	冰轮环境	20,412,973.43	8.87
25	000683	博源化工	19,909,418.00	8.65
26	09926	康方生物	19,113,270.12	8.30
27	603393	新天然气	18,869,050.11	8.20
28	002092	中泰化学	18,793,331.00	8.16
29	603737	三棵树	18,564,096.60	8.07
30	605090	九丰能源	18,134,670.40	7.88
31	601872	招商轮船	17,948,337.40	7.80
32	002080	中材科技	17,703,264.00	7.69
33	603281	江瀚新材	17,625,505.37	7.66
34	00670	中国东方航空 股份	17,349,237.36	7.54
35	301511	德福科技	16,762,864.20	7.28
36	002683	广东宏大	16,758,464.12	7.28
37	600389	江山股份	16,658,412.72	7.24
38	000949	新乡化纤	16,632,800.00	7.23
39	01171	兖矿能源	10,971,355.27	4.77
39	600188	兖矿能源	5,392,651.90	2.34
40	002159	三特索道	16,068,357.00	6.98
41	600219	南山铝业	15,985,118.00	6.94
42	300774	倍杰特	15,819,046.00	6.87
43	601208	东材科技	15,570,176.69	6.76
44	688106	金宏气体	15,447,604.43	6.71
45	605376	博迁新材	15,236,150.00	6.62
46	000703	恒逸石化	15,220,095.00	6.61
47	600603	广汇物流	14,968,710.00	6.50
48	000960	锡业股份	14,933,184.04	6.49
49	603867	新化股份	14,789,230.60	6.43
50	00883	中国海洋石油	11,853,797.63	5.15
50	600938	中国海油	2,625,337.00	1.14
51	300835	龙磁科技	14,255,102.00	6.19
52	603115	海星股份	14,133,528.00	6.14
53	000408	藏格矿业	13,827,710.00	6.01
54	688008	澜起科技	12,882,759.98	5.60
55	001203	大中矿业	12,721,653.00	5.53
56	600299	安迪苏	12,556,156.40	5.46
57	605589	圣泉集团	12,372,210.62	5.38
58	600233	圆通速递	12,184,662.00	5.29
59	600352	浙江龙盛	12,017,923.00	5.22
60	600397	江钨装备	11,878,125.00	5.16
61	601168	西部矿业	11,612,619.00	5.05
62	002475	立讯精密	11,538,229.00	5.01

63	688301	奕瑞科技	11,511,291.02	5.00
64	300390	天华新能	11,358,202.00	4.93
65	688257	新锐股份	11,339,242.52	4.93
66	300308	中际旭创	11,288,766.00	4.90
67	603929	亚翔集成	11,241,537.00	4.88
68	000039	中集集团	10,725,100.50	4.66
69	688196	卓越新能	10,655,956.93	4.63
70	600426	华鲁恒升	10,605,948.00	4.61
71	600711	盛屯矿业	10,522,675.00	4.57
72	002928	华夏航空	10,468,836.00	4.55
73	02099	中国黄金国际	10,438,777.85	4.54
74	688268	华特气体	10,221,108.31	4.44
75	600955	维远股份	10,216,126.00	4.44
76	920438	戈碧迦	10,139,439.72	4.41
77	301217	铜冠铜箔	9,956,967.00	4.33
78	600256	广汇能源	9,752,172.00	4.24
79	06869	长飞光纤光缆	9,653,097.55	4.19
80	600989	宝丰能源	9,591,063.00	4.17
81	002455	百川股份	9,359,269.79	4.07
82	03939	万国黄金集团	9,198,273.98	4.00
83	000506	招金黄金	9,143,168.00	3.97
84	300037	新宙邦	9,105,107.00	3.96
85	603162	海通发展	9,071,305.04	3.94
86	603979	金诚信	9,041,429.00	3.93
87	600595	中孚实业	8,880,350.00	3.86
88	600623	华谊集团	8,863,496.00	3.85
89	000951	中国重汽	8,790,000.00	3.82
90	600754	锦江酒店	8,488,990.42	3.69
91	01378	中国宏桥	8,481,903.23	3.69
92	603259	药明康德	8,450,440.00	3.67
93	09858	优然牧业	8,443,139.81	3.67
94	600183	生益科技	8,291,488.00	3.60
95	000422	湖北宜化	8,101,175.00	3.52
96	300821	东岳硅材	8,046,245.64	3.50
97	300596	利安隆	7,999,136.00	3.48
98	000603	盛达资源	7,937,455.00	3.45
99	600452	涪陵电力	7,759,091.00	3.37
100	00753	中国国航	7,695,301.12	3.34
101	600499	科达制造	7,537,461.00	3.27
102	600338	西藏珠峰	7,422,472.00	3.22
103	000657	中钨高新	7,402,370.00	3.22
104	000990	诚志股份	7,372,638.00	3.20
105	688548	广钢气体	7,260,471.29	3.15

106	301319	唯特偶	7,202,533.24	3.13
107	00358	江西铜业股份	7,193,099.49	3.13
108	603806	福斯特	7,101,657.00	3.09
109	002384	东山精密	7,006,724.00	3.04
110	600309	万华化学	6,983,953.00	3.03
111	600378	昊华科技	6,944,519.00	3.02
112	301526	国际复材	6,834,733.00	2.97
113	601139	深圳燃气	6,570,695.00	2.85
114	600328	中盐化工	6,443,139.90	2.80
115	301338	凯格精机	6,391,695.10	2.78
116	603612	索通发展	6,334,256.00	2.75
117	09699	顺丰同城	6,333,875.49	2.75
118	002734	利民股份	6,271,803.00	2.72
119	601233	桐昆股份	6,264,129.00	2.72
120	300857	协创数据	6,252,167.00	2.72
121	000688	国城矿业	6,226,942.00	2.71
122	02259	紫金黄金国际	6,081,997.46	2.64
123	688697	纽威数控	6,042,757.54	2.63
124	002237	恒邦股份	6,013,098.00	2.61
125	002240	盛新锂能	5,938,082.00	2.58
126	002258	利尔化学	5,827,329.00	2.53
127	601001	晋控煤业	5,736,879.65	2.49
128	688625	呈和科技	5,703,224.42	2.48
129	300819	聚杰微纤	5,702,273.00	2.48
130	600746	江苏索普	5,594,622.00	2.43
131	300483	首华燃气	5,574,330.00	2.42
132	601619	嘉泽新能	5,572,919.00	2.42
133	002001	新 和 成	5,548,749.00	2.41
134	603217	元利科技	5,484,307.00	2.38
135	603688	石英股份	5,398,194.00	2.35
136	03808	中国重汽	5,355,572.79	2.33
137	600323	瀚蓝环境	5,339,136.00	2.32
138	002493	荣盛石化	5,223,029.00	2.27
139	301345	涛涛车业	5,128,015.00	2.23
140	002155	湖南黄金	5,111,027.00	2.22
141	603011	合锻智能	5,094,332.00	2.21
142	000973	佛塑科技	5,026,423.35	2.18
143	600552	凯盛科技	4,938,993.00	2.15
144	603227	雪峰科技	4,893,758.00	2.13
145	600882	妙可蓝多	4,892,327.00	2.13
146	002468	申通快递	4,832,975.00	2.10
147	300986	志特新材	4,745,835.64	2.06
148	603619	中曼石油	4,728,061.00	2.05

149	600025	华能水电	4,702,040.00	2.04
150	688300	联瑞新材	4,653,590.30	2.02
151	002552	宝鼎科技	4,619,491.00	2.01

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,801,515,887.96
卖出股票收入（成交）总额	2,430,209,362.41

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	15,557,170.41	2.60
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,557,170.41	2.60

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	143,000	14,450,040.30	2.41
2	102326	国债 2601	11,000	1,107,130.11	0.18

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

本基金的国债期货投资将以风险管理为原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

无。

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	435,320.39
2	应收清算款	3,265,537.99
3	应收股利	96,009.64
4	应收利息	—
5	应收申购款	241,862.99
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,038,731.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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（%）
融通产业趋势精选混合 A	5,178	36,484.87	87,915,239.10	46.54	101,003,425.46	53.46
融通产业趋势精选混合 C	152,230	2,107.96	298,127,419.24	92.90	22,767,893.49	7.10
合计	157,408	3,238.81	386,042,658.34	75.72	123,771,318.95	24.28

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	9.92

8.3 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	融通产业趋势精选混合 A	804,131.10	0.42565
	融通产业趋势精选混合 C	166,134.29	0.05177
	合计	970,265.39	0.19032

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	融通产业趋势精选混合 A	0
	融通产业趋势精选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通产业趋势精选混合 A	0~10
	融通产业趋势精选混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通产业趋势精选混合 A	融通产业趋势精选混合 C
基金合同生效日（2021 年 3 月 16 日）基金份额总额	377,380,676.72	—
本报告期期初基金份额总额	127,413,091.65	81,235,856.81
本报告期基金总申购份额	197,168,374.77	483,825,000.27
减：本报告期基金总赎回份额	135,662,801.86	244,165,544.35
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	188,918,664.56	320,895,312.73

§ 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2024 年 11 月 12 日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
华福证券	1	925,261,562.16	17.69	406,446.69	17.78	-
国联民生证券	1	715,779,066.30	13.69	312,009.08	13.65	-
财通证券	1	611,912,859.88	11.70	268,412.44	11.74	-
国盛证券	1	533,919,733.11	10.21	232,736.57	10.18	-
国泰海通证券	3	524,866,692.39	10.04	229,051.72	10.02	-
华创证券	2	508,437,641.66	9.72	221,845.54	9.71	-
广发证券	1	381,280,113.02	7.29	167,218.66	7.32	-
长江证券	1	324,928,034.73	6.21	142,977.30	6.26	-
民生证券	1	222,562,429.89	4.26	97,352.28	4.26	-
招商证券	1	196,212,842.78	3.75	85,530.01	3.74	-
中信证券	2	184,105,964.89	3.52	78,507.84	3.43	-
申万宏源	1	100,263,096.05	1.92	43,704.27	1.91	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 租用证券公司交易单元的标准为：

- (1) 财务状况良好，最近一年经审计的净资产原则上不低于 20 亿元；
- (2) 经营行为规范，最近一年内不存在可能影响证券研究服务和经纪业务稳定性的重大行政处罚或者刑事处罚；
- (3) 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；
- (4) 合规风控能力和交易等服务能力较强；
- (5) 拥有良好的公司声誉；
- (6) 交易、研究等服务能力较强，具有全面综合的研究服务能力，或在具体领域具有突出的特色研究服务，或能够提供较好的交易服务，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析

报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

(7) 券商分类监管评级原则上不得为 D 及以下。

2. 租用证券公司交易单元的程序为：

(1) 评价拟引进券商。发起部门组织拟引进券商填写《合作券商审慎调查表》。相关部门对拟引进券商评价。

(2) 上报批准。发起部门将相关部门一致同意的拟引进合作券商情况、评价意见和《合作券商审慎调查表》形成内部审批流程，经相关负责人审批同意后，与券商签署相关协议。

3. 交易单元变更情况

本报告期内交易单元无变更。

10.7.2 基金租用或者通过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	
	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(%)
华福证券	15,511,613.00	43.91	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	9,209,488.00	26.07	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	1,401,326.00	3.97	-	-	-	-
广发证券	2,200,154.00	6.23	-	-	-	-
长江证券	2,002,750.00	5.67	-	-	-	-
民生证券	2,200,205.00	6.23	-	-	-	-
招商证券	1,101,375.00	3.12	-	-	-	-
中信证券	1,702,720.00	4.82	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于取消监事暨监事离任公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 9 日

2	融通产业趋势精选混合型证券投资基金新增兴业证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 13 日
3	关于融通产业趋势精选混合型证券投资基金开通同一基金不同类别基金份额相互转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 20 日
4	融通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
5	2025 年度融通基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 30 日
6	融通基金旗下部分开放式基金新增西南证券股份有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 8 日
7	融通基金旗下部分开放式基金新增恒丰银行股份有限公司为销售机构及开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 27 日
8	融通基金管理有限公司关于暂停中证金牛（北京）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 30 日
9	融通基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 5 日
10	融通基金关于旗下部分开放式基金参加中国人寿保险股份有限公司前端申购费率优惠活动及开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 15 日
11	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 日
12	融通基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 30 日

§ 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2026 年 6 月 26 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，经与各基金托管人协商一致，决定自 2026 年 7 月 27 日起调整旗下部分基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订，

本基金业绩比较基准由沪深 300 指数收益率 $\times$ 45%+中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 30%+中证香港 100 指数收益率 $\times$ 20%+中国战略新兴产业成份指数收益率 $\times$ 5%调整为沪深 300 指数收益率 $\times$ 70%+中证港股通综合指数(港元)收益率 $\times$ 20%+中债-综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 10%。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通产业趋势精选混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通产业趋势精选混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通产业趋势精选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日