

融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金
2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）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 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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 中期财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41

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	41
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	41
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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	42
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	44
§ 11 备查文件目录	45
11.1 备查文件目录	45
11.2 存放地点	45
11.3 查阅方式	45

§ 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 2 年封闭运作混合型证券投资基金
基金简称	融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合
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	377,380,676.72 份
基金合同存续期	不定期

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	涂卫东	秦一楠
	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		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518053	100031
法定代表人		高峰	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	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	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 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(2021 年 3 月 16 日(基金合同生效日) – 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-5,046,640.37
本期利润	18,056,052.67
加权平均基金份额本期利润	0.0478
本期加权平均净值利润率	4.85%
本期基金份额净值增长率	4.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-5,046,640.37
期末可供分配基金份额利润	-0.0134
期末基金资产净值	395,436,729.39
期末基金份额净值	1.0478
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.78%

注：1、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。

2、本报告所列示的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。

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）。

4、本基金的基金合同于 2021 年 3 月 16 日生效，本报告的统计期间为 2021 年 3 月 16 日至本报告期末。

3.2 基金净值表现

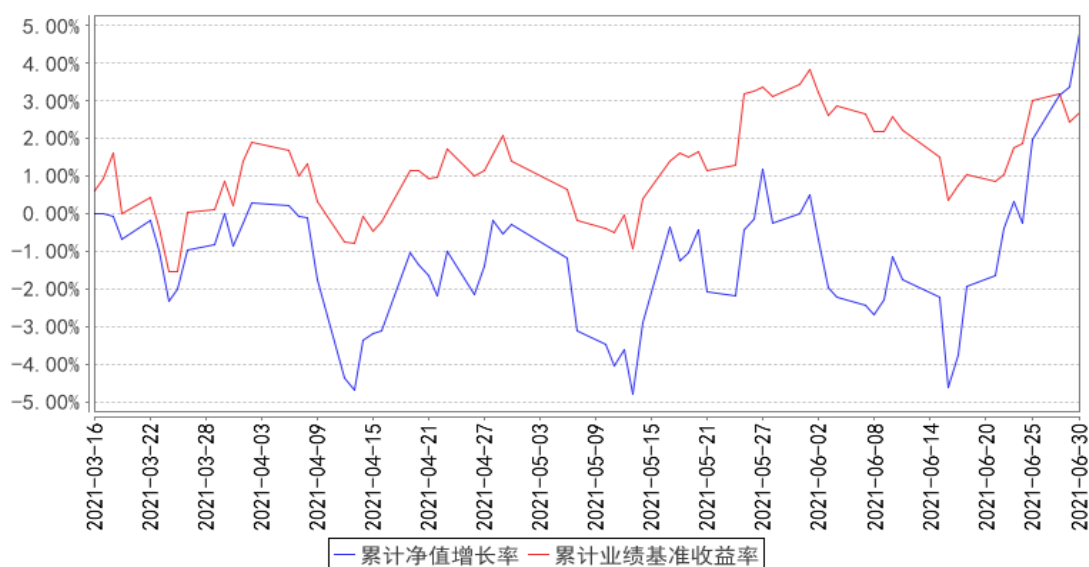
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值	份额净值增长	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④
----	------	--------	-------	---------	-----	-----

	增长率①	率标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去一个月	4.78%	1.13%	-0.73%	0.54%	5.51%	0.59%
过去三个月	5.69%	1.15%	2.45%	0.63%	3.24%	0.52%
自基金合同生效起至今	4.78%	1.09%	2.68%	0.68%	2.10%	0.41%

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2年封闭运作混合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：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 3 月 16 日，至报告期末合同生效未满 1 年。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，截至报告期末，本基金尚在建仓期内。

§ 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：新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（NikkoAssetManagementCo., Ltd.）40%。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理七十六只开放式基金：即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF)、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放

债券型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金 (LOF)、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金 (LOF)、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金 (QDII)、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增悦债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通核心价值混合型证券投资基金 (QDII)、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金、融通通慧混合型证券投资基金、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增强收益债券型证券投资基金、融通消费升级混合型证券投资基金、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增享纯债债券型证券投资基金、融通产业趋势股票型证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通产业趋势先锋股票型证券投资基金、融通通益混合型证券投资基金、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、融通产业趋势臻选股票型证券投资基金、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF)、融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金、融通价值趋势混合型证券投资基金、融通核心趋势混合型证券投资基金。其中，融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

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		
邹曦	本基金的基金经理、副总经理兼权益投资总监	2021 年 3 月 16 日	-	20	邹曦先生，中国人民银行研究生部金融学硕士，20 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2001 年 5 月加入融通基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理、研究部总经理、权益投资部总经理、融通行业景气证券投资基金基金经理（2007 年 6 月 25 日至 2012 年 1 月 18 日）、融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任公司副总经理兼权益投资总监、融通行业景气证券投资基金基金经理、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通产业趋势股票型证券投资基金基金经理、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）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

2021 年上半年 A 股市场窄幅振荡，沪深 300 指数涨幅 0.25%，创业板指数涨幅 17.2%，上半年市场主线特征表现为：通胀预期高企，外需强内需弱，货币宽松信用收紧。这些因素对市场结构产生重大影响。春节是市场风格的分界线。春节之前，市场延续了去年以来的核心资产行情，并呈现出加速赶顶的态势；春节之后，在美债收益率大幅走高的心理暗示下，核心资产整体大幅下跌，市场整体进入中小市值风格占优的阶段。在 2-3 月份市场系统性回调之后，基于基本面的不同，板块走势出现明显分化。在高估值的成长板块中，盈利增长可持续性较强，但增速相对平稳的股票，反弹乏力，而盈利增速较高的股票，则持续创出新高；在低估值的偏周期板块中，与涨价相关的上游资源行业的股票有所上涨，中游制造业受制于成本压力持续走弱。

本基金在成立之后逐步提升股票仓位，目前已经达到基金合同标准之上的较高水平。配置结构中成长价值风格相对均衡。在科技、医药和消费等成长股板块中，重点配置新能源汽车、光伏、自动化、CXO、科技消费、酒店、品牌服装等行业；在周期板块中，重点配置工程机械、重卡、建材等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0478 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.78%，业绩比较基准收益率为 2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年，全球将进入后疫情时代的刺激政策退出阶段，中国由于疫情较早得到有效控制，其经济运行节奏与全球市场会有所不同。预计下半年通胀预期将逐渐消退，外需逐渐走弱，内需逐渐走强，中国经济整体运行平稳健康。上半年中国利用有利的时间窗口，较大程度地化解了历史形成的风险问题，下半年信用将逐渐进入温和扩张，由此货币宽松的状态将逐步逆转。总体而言，下半年与上半年的宏观环境大概率将呈现完全相反的状态。

对于 A 股市场来说，流动性过度宽松状态将结束，盈利增长会持续超预期，对市场形成有效支持，慢牛状态或仍将延续。市场主线在二季度已经从估值提升转向盈利驱动，预计下半年这种状态将延续。一方面，新兴制造业，包括新能源汽车、光伏、通用自动化、科技消费等高成长行业，存在盈利进一步超预期的可能；另一方面，与房地产基建相关的产业链，在上半年受到政策极度压制的状态将有所缓解，其中具备结构性产业趋势的行业，包括工程机械、重卡、建材等，

将重回中长期可持续的增长轨道，从而产生盈利预期回升和估值提升的“戴维斯双击”的投资机会。整体而言，中国制造重新崛起会是未来 2-3 年 A 股市场的主线，一头要把握新兴的先进制造业升级的机会，另一头要把握传统制造业重估的机会。

就本基金而言，仍将保持较高股票仓位，保持风格中性的常态化运作，实现成长价值风格的相对均衡。在科技、医药和消费等成长股板块中，看好新能源汽车、光伏、自动化、CXO、科技消费、酒店、品牌服装等行业；在周期板块中，看好工程机械、重卡、建材等行业。

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证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核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。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

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。其中研究部负责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，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和

国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——融通基金管理有限公司 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	46,605,469.23
结算备付金		1,101,945.88
存出保证金		85,587.57
交易性金融资产	6.4.7.2	348,373,380.65
其中：股票投资		348,373,380.65
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		240,280.93
应收利息	6.4.7.5	9,328.03

应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		396,415,992.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		0.86
应付赎回款		-
应付管理人报酬		460,585.60
应付托管费		76,764.28
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	394,394.48
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	47,517.68
负债合计		979,262.90
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	377,380,676.72
未分配利润	6.4.7.10	18,056,052.67
所有者权益合计		395,436,729.39
负债和所有者权益总计		396,415,992.29

注:1. 报告截止日 2021 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.0478 元, 基金份额总额 377,380,676.72 份。

2. 本基金合同生效日为 2021 年 3 月 16 日, 2021 年中期报告实际报告期间为 2021 年 3 月 16 日至 2021 年 6 月 30 日。截止报告期末本基金合同生效未满一年, 本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体: 融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期: 2021 年 3 月 16 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 3 月 16 日 (基金合同
-----	-----	-----------------------------

		生效日) 至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		20,735,608.36
1. 利息收入		269,188.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	269,188.69
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益		-2,636,273.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,294,332.35
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,658,058.98
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	23,102,693.04
4. 汇兑收益		-
5. 其他收入	6.4.7.18	-
减：二、费用		2,679,555.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,623,289.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	270,548.35
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	733,339.65
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	52,377.82
三、利润总额		18,056,052.67
减：所得税费用		-
四、净利润		18,056,052.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	377,380,676.72	-	377,380,676.72
二、本期经营活动产生的基金净	-	18,056,052.67	18,056,052.67

值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	377,380,676.72	18,056,052.67	395,436,729.39

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：

张帆

颜锡廉

刘美丽

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 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。封闭运作期届满后，本基金转为开放式运作，基金名称变更为“融通产业趋势精选混合型证券投资基金”。除此之外，本基金的基金费率、投资范围和投资策略等均不变。

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 2 年封闭运作混合型证券投资

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：在封闭运作期内，本基金投资组合中股票投资(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；封闭运作期届满转型后，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》、《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》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业

会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 16 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国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(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	46,605,469.23
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	46,605,469.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	325,270,687.61	348,373,380.65	23,102,693.04
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	325,270,687.61	348,373,380.65	23,102,693.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,793.63
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	495.90
应收债券利息	—
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	38.50
合计	9,328.03

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	394,394.48
银行间市场应付交易费用	—
合计	394,394.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
预提费用	47,517.68
合计	47,517.68

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
----	---

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	377,380,676.72	377,380,676.72
本期申购	—	—
本期赎回	—	—
本期末	377,380,676.72	377,380,676.72

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自 2021 年 2 月 25 日至 2021 年 3 月 12 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 377,169,209.87 元。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招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 211,466.85 元在本基金成立后，折算为 211,466.85 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、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》及《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》的相关规定，本基金于 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2023 年 3 月 15 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	-5,046,640.37	23,102,693.04	18,056,052.67
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-5,046,640.37	23,102,693.04	18,056,052.67

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	264,292.69
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	4,650.37
其他	245.63
合计	269,188.69

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,294,332.35
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	-4,294,332.35

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	130,351,012.58
减：卖出股票成本总额	134,645,344.93
买卖股票差价收入	-4,294,332.35

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月16日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,658,058.98
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	1,658,058.98

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年3月16日（基金合同生效日） 至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	23,102,693.04

股票投资	23,102,693.04
债券投资	—
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	23,102,693.04

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	733,339.65
银行间市场交易费用	—
合计	733,339.65

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	10,965.70
信息披露费	36,551.98
证券出借违约金	—
银行费用	4,460.14
其他	400.00
合计	52,377.82

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
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳市融通资本管理股份有限公司（“融通资本”）	本基金管理人能实施重大影响的联营企业

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、融通资本为融通基金持有 52.575%股权比例的基金管理公司子公司。

6.4.10 本报告期的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,623,289.87
其中：支付销售机构的客户维护费	712,346.25

注：1、支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	270,548.35

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 3 月 16 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	46,605,469.23	264,292.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 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(2021 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	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
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	首发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	首发流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	首发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	首发流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	首发流通受限	12.1	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	首发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	首发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	首发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	首发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	首发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	首发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	首发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	首发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	首发流通受限	14.2	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	首发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	首发流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	首发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	首发流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	首发流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	首发流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	首发流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	首发流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	首发流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	首发流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688161	威高骨科	2021 年 6 月	2021 年 12 月	首发流	36.22	82.27	2,465	89,282.30	202,795.55	-

		月 23 日	月 30 日	通受限						
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	首发流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688323	瑞华泰	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 28 日	首发流通受限	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 3 日	首发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期风险及收益水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高风险收益水平的投资品种。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。

董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略；审议重大事件、重大决策的风险评估意见，审批重大风险的解决方案，批准公司基本风险管理制度；审议公司风险管理报告。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。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；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；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；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。

各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理制度和流程的有效性负责。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；对风险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

监察稽核部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，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人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 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未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。截止 2021 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	46,605,469.23	-	-	-	46,605,469.23
结算备付金	1,101,945.88	-	-	-	1,101,945.88
存出保证金	85,587.57	-	-	-	85,587.57
交易性金融资产	-	-	-	348,373,380.65	348,373,380.65
应收利息	-	-	-	9,328.03	9,328.03
应收证券清算款	-	-	-	240,280.93	240,280.93
资产总计	47,793,002.68	-	-	348,622,989.61	396,415,992.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	460,585.60	460,585.60
应付托管费	-	-	-	76,764.28	76,764.28
应付证券清算款	-	-	-	0.86	0.86
应付交易费用	-	-	-	394,394.48	394,394.48
其他负债	-	-	-	47,517.68	47,517.68
负债总计	-	-	-	979,262.90	979,262.90
利率敏感度缺口	47,793,002.68	-	-	347,643,726.71	395,436,729.39

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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，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 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,839,017.42	-	3,839,017.42
资产合计	-	3,839,017.42	-	3,839,017.42
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	-	3,839,017.42	-	3,839,017.42

6.4.13.4.2.2 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（2021 年 6 月 30 日）	
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	191,950.87	
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-191,950.87	

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 2021 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	348,373,380.65	88.10
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	348,373,380.65	88.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金合同生效尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	348,373,380.65	87.88
	其中：股票	348,373,380.65	87.88
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—

7	银行存款和结算备付金合计	47,707,415.11	12.03
8	其他各项资产	335,196.53	0.08
9	合计	396,415,992.29	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	303,599,712.18	76.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	17,939.46	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	11,116,640.00	2.81
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,477.64	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,875,290.00	4.01
M	科学研究和技术服务业	13,822,263.00	3.50
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	344,534,363.23	87.13

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（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	3,839,017.42	0.97
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-

合计	3,839,017.42	0.97
----	--------------	------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	300124	汇川技术	558,150	41,448,219.00	10.48
2	601100	恒立液压	442,500	38,019,600.00	9.61
3	600031	三一重工	1,197,000	34,796,790.00	8.80
4	000338	潍柴动力	1,868,526	33,390,559.62	8.44
5	601012	隆基股份	301,220	26,760,384.80	6.77
6	603737	三棵树	98,181	17,279,856.00	4.37
7	300750	宁德时代	31,400	16,792,720.00	4.25
8	601888	中国中免	52,900	15,875,290.00	4.01
9	601636	旗滨集团	764,100	14,181,696.00	3.59
10	300759	康龙化成	63,700	13,822,263.00	3.50
11	688696	极米科技	13,893	11,558,976.00	2.92
12	600754	锦江酒店	195,200	11,116,640.00	2.81
13	601689	拓普集团	188,700	7,063,041.00	1.79
14	000661	长春高新	17,303	6,696,261.00	1.69
15	603659	璞泰来	44,860	6,127,876.00	1.55
16	000951	中国重汽	223,436	6,046,178.16	1.53
17	300274	阳光电源	51,300	5,902,578.00	1.49
18	002614	奥佳华	254,000	5,748,020.00	1.45
19	688007	光峰科技	133,207	5,578,709.16	1.41
20	600166	福田汽车	1,519,300	5,241,585.00	1.33
21	688599	天合光能	146,768	4,160,872.80	1.05
22	300782	卓胜微	7,400	3,977,500.00	1.01
23	000550	江铃汽车	168,700	3,952,641.00	1.00
24	03690	美团-W	14,400	3,839,017.42	0.97
25	601058	赛轮轮胎	382,500	3,821,175.00	0.97
26	003016	欣贺股份	121,800	1,950,018.00	0.49
27	002539	云图控股	204,000	1,780,920.00	0.45
28	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.10
29	688276	百克生物	2,493	260,717.94	0.07
30	688161	威高骨科	2,465	202,795.55	0.05
31	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.03
32	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
33	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
34	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
35	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01

36	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
37	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
38	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
39	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
40	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
41	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
42	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
43	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
44	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
45	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
46	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
47	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
48	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
49	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
50	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
51	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
52	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
53	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
54	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
55	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
56	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
57	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
58	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
59	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
60	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600031	三一重工	42,802,926.80	10.82
2	000338	潍柴动力	36,794,109.68	9.30
3	601100	恒立液压	35,801,330.00	9.05
4	300124	汇川技术	35,232,689.87	8.91
5	601888	中国中免	28,840,163.00	7.29
6	601012	隆基股份	27,682,781.15	7.00
7	000157	中联重科	19,181,013.70	4.85
8	000661	长春高新	18,707,182.00	4.73
9	300759	康龙化成	15,704,499.26	3.97
10	603737	三棵树	15,311,112.36	3.87
11	300750	宁德时代	14,184,897.00	3.59
12	601966	玲珑轮胎	12,970,685.00	3.28

13	601636	旗滨集团	12,649,609.00	3.20
14	600754	锦江酒店	12,296,560.60	3.11
15	000951	中国重汽	11,660,502.04	2.95
16	300737	科顺股份	10,888,314.00	2.75
17	600166	福田汽车	9,422,630.00	2.38
18	000550	江铃汽车	7,776,393.67	1.97
19	603833	欧派家居	7,629,688.00	1.93
20	601689	拓普集团	7,407,094.00	1.87

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000157	中联重科	16,189,602.36	4.09
2	601966	玲珑轮胎	12,069,924.36	3.05
3	601888	中国中免	10,602,908.60	2.68
4	300737	科顺股份	9,583,526.00	2.42
5	000661	长春高新	8,841,998.78	2.24
6	601012	隆基股份	7,724,714.00	1.95
7	603833	欧派家居	6,683,004.40	1.69
8	300759	康龙化成	5,864,450.00	1.48
9	601233	桐昆股份	5,448,172.00	1.38
10	601919	中远海控	4,161,329.00	1.05
11	000807	云铝股份	3,986,565.00	1.01
12	600031	三一重工	3,740,104.00	0.95
13	603260	合盛硅业	3,610,814.00	0.91
14	600036	招商银行	3,584,627.00	0.91
15	002430	杭氧股份	3,332,838.12	0.84
16	000550	江铃汽车	3,057,971.00	0.77
17	000951	中国重汽	2,895,041.00	0.73
18	300124	汇川技术	2,697,313.00	0.68
19	600166	福田汽车	2,309,365.00	0.58
20	603659	璞泰来	1,876,611.00	0.47

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	459,916,032.54
卖出股票收入（成交）总额	130,351,012.58

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，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

无。

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

无。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，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。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具对投资组合进行管理。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

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	85,587.57
2	应收证券清算款	240,280.93
3	应收股利	—
4	应收利息	9,328.03
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	335,196.53

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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
9,971	37,847.83	10,881,823.72	2.88	366,498,853.00	97.12

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	728,944.14	0.19316

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 3 月 16 日）基金份额总额	377,380,676.72
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	377,380,676.72

§ 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 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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

本报告期内基金的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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	218,885,720.97	37.26%	199,470.98	37.08%	—
中信证券	1	196,062,237.34	33.38%	181,380.64	33.71%	—

太平洋证券	1	101,741,633.54	17.32%	92,714.47	17.23%	-
广发证券	1	30,865,113.44	5.25%	28,125.58	5.23%	-
招商证券	1	24,604,038.69	4.19%	22,421.51	4.17%	-
国泰君安	1	15,240,326.87	2.59%	13,888.74	2.58%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期交易单元均为本报告期新增，无其他变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金关	上海证券报、	2021-02-03

	于向养老金客户开展认购费率优惠活动的公告	管理人网站	
2	融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、管理人网站	2021-02-10
3	融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司等销售机构的公告	上海证券报、管理人网站	2021-02-22
4	融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、管理人网站	2021-02-25
5	融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、管理人网站	2021-02-26
6	融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、管理人网站	2021-03-01
7	融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金新增销售机构的公告	上海证券报、管理人网站	2021-03-02
8	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生效公告	上海证券报、管理人网站	2021-03-17

§ 11 备查文件目录

11.1 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 2 年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《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》
- (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

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

11.3 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

2021 年 8 月 27 日