

# 融通转型三动力灵活配置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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通转型三动力灵活配置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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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
<b>§ 6 中期财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44

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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	44
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
11.1 备查文件目录 .....	50
11.2 存放地点 .....	50
11.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	融通转型三动力灵活配置混合	
基金主代码	000717	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 1 月 16 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	161,394,737.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	000717	009828
下属分级基金的前端交易代码	000717	-
下属分级基金的后端交易代码	000718	-
报告期末下属分级基金的份额总额	159,140,422.36 份	2,254,315.36 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要挖掘经济转型过程中高端装备制造业、医疗保健行业、信息产业等三个行业发展带来的投资机会，在合理控制投资风险的基础上，获取基金资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的长期收益。
投资策略	本基金采用“自下而上，个股优选”的投资策略，挖掘经济转型带来的投资机会，重点投资高端装备制造业、医疗保健行业、信息产业三大行业的股票，构建在中长期能够从转型中受益的投资组合。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中债综合（全价）指数收益率
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与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	李申
	联系电话	(0755) 26948666	(021) 60637102
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	(021) 60637111
传真		(0755) 26935005	(021) 60635778
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518053	100033

法定代表人	高峰	田国立
-------	----	-----

## 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1月1日-2021年6月30日)	
	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C
本期已实现收益	142,047,149.77	5,543,906.04
本期利润	9,976,377.52	33,702.06
加权平均基金份额本期利润	0.0526	0.0047
本期加权平均净值利润率	1.79%	0.16%
本期基金份额净值增长率	1.15%	0.89%
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	322,147,352.35	4,531,435.83
期末可供分配基金份额利润	2.0243	2.0101
期末基金资产净值	489,618,336.71	6,907,354.93
期末基金份额净值	3.077	3.064
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	207.70%	-1.54%

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

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

3、期末可供分配基金份额利润=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

融通转型三动力灵活配置混合 A/B

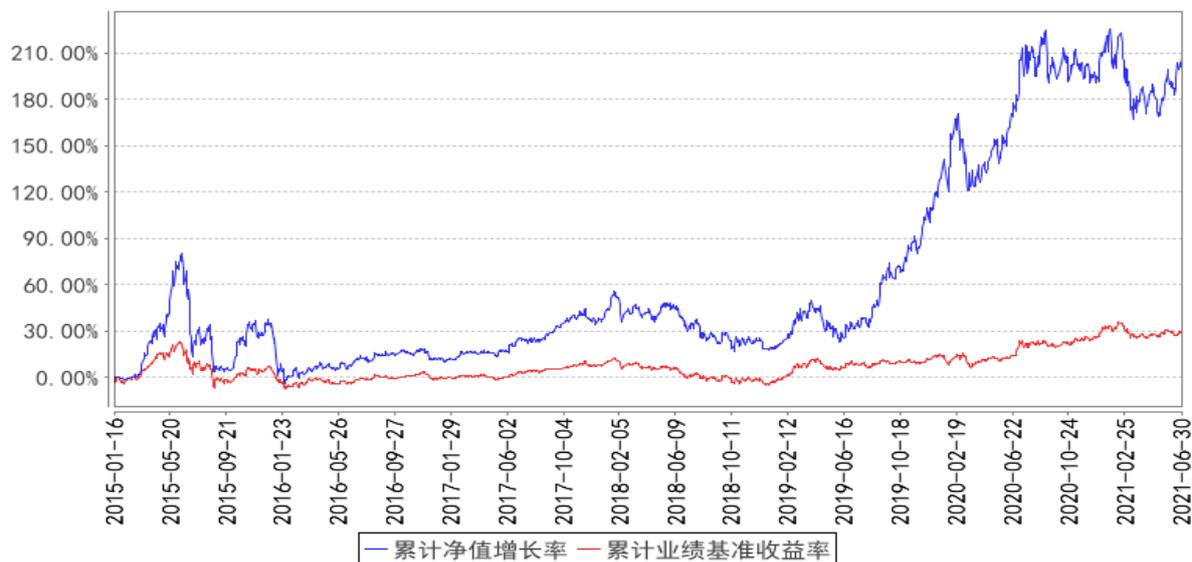
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.36%	1.36%	-1.02%	0.40%	4.38%	0.96%
过去三个月	10.21%	1.28%	2.03%	0.49%	8.18%	0.79%
过去六个月	1.15%	1.58%	0.70%	0.66%	0.45%	0.92%
过去一年	8.88%	1.57%	12.51%	0.66%	-3.63%	0.91%
过去三年	125.09%	1.66%	26.94%	0.67%	98.15%	0.99%
自基金合同生效起至今	207.70%	1.61%	29.28%	0.75%	178.42%	0.86%

融通转型三动力灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.30%	1.35%	-1.02%	0.40%	4.32%	0.95%
过去三个月	10.06%	1.28%	2.03%	0.49%	8.03%	0.79%
过去六个月	0.89%	1.58%	0.70%	0.66%	0.19%	0.92%
自基金合同生效起至今	-1.54%	1.50%	6.29%	0.60%	-7.83%	0.90%

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

融通转型三动力灵活配置混合A/B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



融通转型三动力灵活配置混合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 2020 年 7 月 29 日增设 C 类份额，该类份额首次确认日为 2020 年 7 月 30 日，故本基金 C 类份额的统计区间为 2020 年 7 月 30 日至本报告期末。

## § 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		
林清源	本基金的基金经理	2018/6/22	-	10	林清源先生，美国宾夕法尼亚大学系统工程硕士，10 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2011 年 7 月加入融通基金管理有限公司，历任互联网传媒行业研究员、家电行业研究员、计算机行业研究员、

					融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理，现任融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长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 年上半年本基金减持了中游制造方向上的配置，增加了物联网和智能驾驶方向的配置。

随着 5G 的落地，需求侧场景的逐步发展，物联网产业链进入发展黄金期并逐步体现出规模效应。我们判断物联网迎来长期的投资机会。相较于传统电子手机产业链，物联网下游更加多元化，天花板更高，是长期更具潜力的成长赛道。基于以上判断本基金看好物联网在下半年的投资机会，并增强了对物联网方向的配置。

风格上，本基金更看好中小盘成长股，从基本面看，已经验证了许多中小盘股的困境反转，后续会有更多的中小盘股通过持续的业绩释放验证其基本面的改善。同时从节奏看，去年疫情的

不确定性导致市场更多偏好稳健的大盘龙头公司的，但随着经济的恢复性增长，部分优质中小盘公司将体现更大的业绩弹性，相应的市场风险偏好也有可能转向小盘成长股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通转型三动力灵活配置混合 A/B 基金份额净值为 3.077 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.15%；截至本报告期末融通转型三动力灵活配置混合 C 基金份额净值为 3.064 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.89%；同期业绩比较基准收益率为 0.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金致力于自下而上挖掘优质公司，不把重心放在对宏观和市场的判断上，投资策略上长期保持较高仓位。报告期内市场科技方向热度持续提升，中国也在经历从制造业人口红利向工程师红利转型的过程，虽然部分龙头公司估值有些高，但总体而言市场依然是机会大于风险。

#### 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其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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：融通转型三动力灵活配置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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	31,632,260.87	60,450,404.08
结算备付金		658,638.92	948,872.09
存出保证金		188,823.18	311,714.02
交易性金融资产	6.4.7.2	469,154,885.94	857,353,835.82
其中：股票投资		469,154,885.94	857,339,675.95
基金投资		-	-
债券投资		-	14,159.87
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		16,050,703.16	2,691,990.80
应收利息	6.4.7.5	3,333.87	6,738.26

应收股利		-	-
应收申购款		370,105.99	787,589.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		518,058,751.93	922,551,144.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,374,940.54	-
应付赎回款		7,828,860.57	15,538,692.91
应付管理人报酬		613,615.94	1,210,333.07
应付托管费		102,269.33	201,722.17
应付销售服务费		4,668.49	17,478.76
应付交易费用	6.4.7.7	474,847.69	748,671.37
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	133,857.73	272,702.82
负债合计		21,533,060.29	17,989,601.10
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	161,394,737.72	297,333,802.07
未分配利润	6.4.7.10	335,130,953.92	607,227,741.79
所有者权益合计		496,525,691.64	904,561,543.86
负债和所有者权益总计		518,058,751.93	922,551,144.96

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 161,394,737.72 份，其中融通转型三动力灵活配置混合 A/B 基金份额总额 159,140,422.36 份，基金份额净值 3.077 元。融通转型三动力灵活配置混合 C 基金份额总额 2,254,315.36 份，基金份额净值 3.064 元。

## 6.2 利润表

会计主体：融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
一、收入		17,333,867.74	304,241,878.84
1. 利息收入		75,209.82	466,029.25

其中：存款利息收入	6.4.7.11	75,206.54	465,469.92
债券利息收入		3.28	559.33
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		153,899,934.50	87,284,422.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	152,115,463.08	77,655,149.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,740.80	61,770.66
资产支持证券投资收益		-	-
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	1,775,730.62	9,567,501.59
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-137,580,976.23	202,968,337.88
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	939,699.65	13,523,089.63
减：二、费用		7,323,788.16	17,235,119.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,318,566.99	9,635,637.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	719,761.22	1,605,939.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	52,366.14	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,104,687.36	5,879,404.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	1.95
7. 其他费用	6.4.7.20	128,406.45	114,136.36
三、利润总额		10,010,079.58	287,006,759.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润		10,010,079.58	287,006,759.18

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 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）	297,333,802.07	607,227,741.79	904,561,543.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,010,079.58	10,010,079.58
三、本期基金份额交易产生的	-135,939,064.35	-282,106,867.45	-418,045,931.80

基金净值变动数			
其中：1. 基金申购款	43,918,963.95	85,299,209.01	129,218,172.96
2. 基金赎回款	-179,858,028.30	-367,406,076.46	-547,264,104.76
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）	161,394,737.72	335,130,953.92	496,525,691.64
项目	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020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）	336,584,137.06	370,328,291.11	706,912,428.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	287,006,759.18	287,006,759.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	143,089,222.72	218,439,069.99	361,528,292.71
其中：1. 基金申购款	1,177,810,379.30	1,696,348,141.18	2,874,158,520.48
2. 基金赎回款	-1,034,721,156.58	-1,477,909,071.19	-2,512,630,227.77
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）	479,673,359.78	875,774,120.28	1,355,447,480.06

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

融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 625 号《关于同意融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 664,422,720.01 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(2015)第 044 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 664,827,527.20 份基金份额,其

中认购资金利息折合 404,807.19 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2020 年 7 月 27 日发布的《融通基金管理有限公司关于融通转型三动力灵活配置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》，自 2020 年 7 月 29 日起对本基金进行份额分类，原有基金份额为 A/B 类份额，增设 C 类份额。在投资者申购时收取前端申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者赎回时收取后端申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 B 类基金份额；不收取前/后端申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金分类后，本基金原有基金份额将自动划归为本基金 A/B 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等），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）。本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）占基金资产的 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证券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；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资于转型受益的高端装备制造业、医疗保健行业、信息产业三个行业的证券资产合计不低于非现金基金资产的 80%，同时三类行业的投资在非现金基金资产中的占比还应满足：高端装备制造业为 0-60%，医疗保健行业为 0-60%，信息产业为 0-60%。本基金的业绩比较基准为：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中债综合（全价）指数收益率。

#### 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》、《融通转型三动力灵活配置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 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

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	31,632,260.87	
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	31,632,260.87	

##### 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	452,510,895.49	469,154,885.94	16,643,990.45
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	452,510,895.49	469,154,885.94	16,643,990.45

##### 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	2,952.47
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	296.40
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	85.00
合计	3,333.87

**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	474,847.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	474,847.69

**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	20,261.79
应付证券出借违约金	-
预提费用	113,595.94

合计	133,857.73
----	------------

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 融通转型三动力灵活配置混合 A/B

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	285,293,361.74	285,293,361.74
本期申购	39,158,986.08	39,158,986.08
本期赎回	-165,311,925.46	-165,311,925.46
本期末	159,140,422.36	159,140,422.36

## 融通转型三动力灵活配置混合 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,040,440.33	12,040,440.33
本期申购	4,759,977.87	4,759,977.87
本期赎回	-14,546,102.84	-14,546,102.84
本期末	2,254,315.36	2,254,315.36

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

## 融通转型三动力灵活配置混合 A/B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	382,052,299.13	200,644,363.00	582,696,662.13
本期利润	142,047,149.77	-132,070,772.25	9,976,377.52
本期基金份额交易产生的变动数	-201,952,096.55	-60,243,028.75	-262,195,125.30
其中：基金申购款	67,318,794.53	8,970,294.98	76,289,089.51
基金赎回款	-269,270,891.08	-69,213,323.73	-338,484,214.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	322,147,352.35	8,330,562.00	330,477,914.35

## 融通转型三动力灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,060,676.35	8,470,403.31	24,531,079.66
本期利润	5,543,906.04	-5,510,203.98	33,702.06
本期基金份额交易产生的变动数	-17,073,146.56	-2,838,595.59	-19,911,742.15
其中：基金申购款	7,976,139.53	1,033,979.97	9,010,119.50
基金赎回款	-25,049,286.09	-3,872,575.56	-28,921,861.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,531,435.83	121,603.74	4,653,039.57

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	67,977.92
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	5,171.98
其他	2,056.64
合计	75,206.54

## 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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	152,115,463.08
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	152,115,463.08

## 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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	827,989,612.57
减：卖出股票成本总额	675,874,149.49
买卖股票差价收入	152,115,463.08

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付） 差价收入	8,740.80
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	8,740.80

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,844.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	14,099.94
减：应收利息总额	3.62
买卖债券差价收入	8,740.80

#### 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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,775,730.62
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	1,775,730.62

#### 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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-137,580,976.23
股票投资	-137,580,916.30
债券投资	-59.93
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	-137,580,976.23

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	868,580.30

基金转换费收入	71,119.35
合计	939,699.65

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金赎回费用的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,104,687.36
银行间市场交易费用	-
合计	2,104,687.36

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	10,310.51
账户维护费	9,000.00
合计	128,406.45

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

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1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,318,566.99	9,635,637.42
其中：支付销售机构的客户维护费	1,689,432.03	3,702,854.93

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1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	719,761.22	1,605,939.56

注：支付基金托管人中国建设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。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C	合计
融通基金	-	163.32	163.32
合计	-	163.32	163.32

注：1、本基金 A/B 类基金份额不收取销售服务费。

2、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%的年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付给融通基金，再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。  
其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类的基金资产净值×0.50%/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1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国建设银行	31,632,260.87	67,977.92	88,849,142.25	431,169.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021/5/18	2021/11/25	首发流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020/12/29	2021/7/7	首发流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020/12/29	2021/7/7	首发流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021/1/12	2021/7/20	首发流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

300930	屹通新材	2021/1/13	2021/7/21	首发流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021/1/13	2021/7/21	首发流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021/1/15	2021/7/22	首发流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021/1/15	2021/7/22	首发流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021/1/20	2021/7/27	首发流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300941	创识科技	2021/2/2	2021/8/9	首发流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021/2/2	2021/8/9	首发流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021/2/3	2021/8/10	首发流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021/2/3	2021/8/10	首发流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021/2/18	2021/8/25	首发流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021/6/4	2021/8/25	流通受限	0.00	27.42	108	0.00	2,961.36	-
300950	德固特	2021/2/24	2021/9/3	首发流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021/3/3	2021/9/13	首发流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021/3/11	2021/9/22	首发流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021/3/16	2021/9/24	首发流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021/3/16	2021/9/27	首发流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021/3/18	2021/9/27	首发流通受限	47.33	251.96	368	17,417.44	92,721.28	-
300958	建工修复	2021/3/18	2021/9/29	首发流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021/3/22	2021/9/29	首发流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021/3/23	2021/9/30	首发流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021/3/29	2021/10/11	首发流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021/3/31	2021/10/11	首发流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021/4/2	2021/10/13	首发流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021/4/6	2021/10/15	首发流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021/4/7	2021/10/15	首发流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021/4/8	2021/10/15	首发流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021/4/14	2021/10/21	首发流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021/4/15	2021/10/26	首发流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021/4/15	2021/10/26	首发流通受限	33.22	87.50	648	21,526.56	56,700.00	-
300981	中红医疗	2021/4/19	2021/10/27	首发流通受限	48.59	90.39	356	17,298.04	32,178.84	-
300982	苏文电能	2021/4/19	2021/10/27	首发流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特新材	2021/4/21	2021/11/1	首发流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021/4/28	2021/11/11	首发流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021/5/12	2021/11/22	首发流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021/5/17	2021/11/25	首发流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021/5/17	2021/11/24	首发流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021/5/17	2021/11/26	首发流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021/5/26	2021/12/3	首发流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021/5/26	2021/12/2	首发流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021/5/25	2021/12/2	首发流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021/5/27	2021/12/7	首发流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021/6/18	2021/12/27	首发流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-

301007	德迈仕	2021/6/4	2021/12/16	首发流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021/6/9	2021/12/20	首发流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021/6/9	2021/12/17	首发流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021/6/15	2021/12/22	首发流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021/6/22	2021/12/30	首发流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021/6/23	2021/12/30	首发流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021/6/28	2021/7/6	首发流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021/6/28	2022/1/6	首发流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021/6/28	2021/7/6	首发流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021/6/28	2022/1/6	首发流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021/6/2	2021/12/10	首发流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021/6/29	2021/7/7	首发流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021/6/28	2021/7/6	首发流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688076	诺泰生物	2021/5/12	2021/11/22	首发流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021/6/30	2022/1/10	首发流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021/6/28	2021/7/7	首发流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688276	百克生物	2021/6/17	2021/12/27	首发流通受限	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688395	正弦电气	2021/4/21	2021/10/29	首发流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688499	利元亨	2021/6/23	2021/7/1	首发流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688607	康众医疗	2021/1/25	2021/8/2	首发流通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688626	翔宇医疗	2021/3/23	2021/10/8	首发流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688665	四方光电	2021/2/2	2021/8/9	首发流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
688667	菱电电控	2021/3/3	2021/9/13	首发流通受限	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-
688676	金盘科技	2021/3/2	2021/9/9	首发流通受限	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。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，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。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涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了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建设银行，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 (2021 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0016%)。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。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。于 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、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	31,632,260.87	-	-	-	31,632,260.87
结算备付金	658,638.92	-	-	-	658,638.92
存出保证金	188,823.18	-	-	-	188,823.18
交易性金融资产	-	-	-	469,154,885.94	469,154,885.94
应收利息	-	-	-	3,333.87	3,333.87
应收申购款	-	-	-	370,105.99	370,105.99
应收证券清算款	-	-	-	16,050,703.16	16,050,703.16
资产总计	32,479,722.97	-	-	485,579,028.96	518,058,751.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,828,860.57	7,828,860.57
应付管理人报酬	-	-	-	613,615.94	613,615.94
应付托管费	-	-	-	102,269.33	102,269.33
应付证券清算款	-	-	-	12,374,940.54	12,374,940.54
应付销售服务费	-	-	-	4,668.49	4,668.49
应付交易费用	-	-	-	474,847.69	474,847.69
其他负债	-	-	-	133,857.73	133,857.73

负债总计	-	-	-	21,533,060.29	21,533,060.29
利率敏感度缺口	32,479,722.97	-	-	-464,045,968.67	496,525,691.64
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	60,450,404.08	-	-	-	60,450,404.08
结算备付金	948,872.09	-	-	-	948,872.09
存出保证金	311,714.02	-	-	-	311,714.02
交易性金融资产	-	-	14,159.87	857,339,675.95	857,353,835.82
应收利息	-	-	-	6,738.26	6,738.26
应收申购款	-	-	-	787,589.89	787,589.89
应收证券清算款	-	-	-	2,691,990.80	2,691,990.80
资产总计	61,710,990.19	-	14,159.87	860,825,994.90	922,551,144.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,538,692.91	15,538,692.91
应付管理人报酬	-	-	-	1,210,333.07	1,210,333.07
应付托管费	-	-	-	201,722.17	201,722.17
应付销售服务费	-	-	-	17,478.76	17,478.76
应付交易费用	-	-	-	748,671.37	748,671.37
其他负债	-	-	-	272,702.82	272,702.82
负债总计	-	-	-	17,989,601.10	17,989,601.10
利率敏感度缺口	61,710,990.19	-	14,159.87	842,836,393.80	904,561,543.86

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(2020 年 12 月 31 日：0.0016%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单

个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)占基金资产的 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证券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。基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	469,154,885.94	94.49	857,339,675.95	94.78
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	469,154,885.94	94.49	857,339,675.95	94.78

#### 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 (2021年6月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
	1. 沪深 300 指数收益率上升 5%	23,123,230.52	45,698,514.64
2. 沪深 300 指数收益率下降 5%	-23,123,230.52	-45,698,514.64	

#### 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	469,154,885.94	90.56
	其中：股票	469,154,885.94	90.56
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	32,290,899.79	6.23
8	其他各项资产	16,612,966.20	3.21
9	合计	518,058,751.93	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	13,788.85	0.00
B	采矿业	1,181.59	0.00
C	制造业	349,334,643.05	70.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,166,190.01	1.04
E	建筑业	34,447.02	0.01
F	批发和零售业	21,507,001.12	4.33
G	交通运输、仓储和邮政业	16,505,634.57	3.32
H	住宿和餐饮业	153.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,023,763.50	12.29
J	金融业	65,064.30	0.01
K	房地产业	976.08	0.00
L	租赁和商务服务业	2,967.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	15,434,720.06	3.11
N	水利、环境和公共设施管理业	53,495.50	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,712.73	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,147.12	0.00
S	综合	-	-
	合计	469,154,885.94	94.49

## 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	537,677	39,927,894.02	8.04

2	300724	捷佳伟创	343,514	39,851,059.14	8.03
3	603236	移远通信	226,216	38,594,711.76	7.77
4	002891	中宠股份	863,308	35,395,628.00	7.13
5	300785	值得买	367,837	34,944,515.00	7.04
6	002599	盛通股份	8,386,100	32,034,902.00	6.45
7	603039	泛微网络	381,551	25,392,219.05	5.11
8	002920	德赛西威	228,900	25,197,312.00	5.07
9	688268	华特气体	328,813	24,720,161.34	4.98
10	002026	山东威达	1,593,500	21,767,210.00	4.38
11	002727	一心堂	640,600	21,210,266.00	4.27
12	300873	海晨股份	385,400	16,498,974.00	3.32
13	603738	泰晶科技	450,960	15,567,139.20	3.14
14	002389	航天彩虹	695,400	15,180,582.00	3.06
15	300149	睿智医药	765,700	14,770,353.00	2.97
16	000049	德赛电池	286,805	13,164,349.50	2.65
17	002351	漫步者	791,900	10,722,326.00	2.16
18	300638	广和通	182,600	8,527,420.00	1.72
19	002594	比亚迪	26,400	6,626,400.00	1.33
20	688002	睿创微纳	64,059	6,395,009.97	1.29
21	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	1.04
22	000547	航天发展	266,000	5,019,420.00	1.01
23	300782	卓胜微	4,800	2,580,000.00	0.52
24	002636	金安国纪	110,200	1,787,444.00	0.36
25	002241	歌尔股份	39,300	1,679,682.00	0.34
26	300012	华测检测	20,000	637,600.00	0.13
27	688020	方邦股份	5,707	530,579.79	0.11
28	603444	吉比特	1,000	530,000.00	0.11
29	688036	传音控股	2,000	419,000.00	0.08
30	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.08
31	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.08
32	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.07
33	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.06
34	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.05
35	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.05
36	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.04
37	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.02
38	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
39	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
40	300957	贝泰妮	368	92,721.28	0.02
41	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.02
42	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
43	688111	金山办公	193	76,196.40	0.02

44	300896	爱美客	91	71,788.08	0.01
45	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.01
46	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.01
47	300979	华利集团	648	56,700.00	0.01
48	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
49	300894	火星人	679	46,172.00	0.01
50	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
51	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
52	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
53	300981	中红医疗	356	32,178.84	0.01
54	300953	震裕科技	294	29,847.30	0.01
55	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
56	688621	阳光诺和	272	24,153.60	0.00
57	688625	呈和科技	435	23,242.05	0.00
58	688319	欧林生物	585	21,884.85	0.00
59	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
60	300937	药易购	334	18,057.04	0.00
61	603290	斯达半导	56	17,920.00	0.00
62	300982	苏文电能	370	17,322.28	0.00
63	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
64	300932	三友联众	518	16,437.22	0.00
65	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
66	300955	嘉亨家化	314	14,830.88	0.00
67	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
68	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
69	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
70	300966	共同药业	358	12,311.56	0.00
71	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
72	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
73	300918	南山智尚	1,126	11,721.66	0.00
74	300933	中辰股份	1,117	11,662.18	0.00
75	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
76	300962	中金辐照	657	11,373.12	0.00
77	300950	德固特	286	11,320.49	0.00
78	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
79	300958	建工修复	393	10,879.74	0.00
80	300952	恒辉安防	398	10,840.48	0.00
81	300986	志特新材	332	10,808.84	0.00
82	605358	立昂微	93	10,748.94	0.00
83	300956	英力股份	407	10,548.12	0.00
84	300930	屹通新材	420	10,321.78	0.00
85	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00

86	300945	曼卡龙	531	10,073.73	0.00
87	688597	煜邦电力	785	9,906.70	0.00
88	300961	深水海纳	436	9,727.10	0.00
89	600745	闻泰科技	100	9,690.00	0.00
90	300991	创益通	335	9,662.50	0.00
91	300931	通用电梯	713	9,360.14	0.00
92	688613	奥精医疗	103	9,351.37	0.00
93	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
94	605111	新洁能	49	8,833.23	0.00
95	300926	博俊科技	384	8,534.80	0.00
96	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
97	300987	川网传媒	304	8,186.69	0.00
98	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
99	300861	美畅股份	95	8,009.45	0.00
100	300927	江天化学	263	7,928.72	0.00
101	300943	春晖智控	342	7,925.10	0.00
102	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
103	688067	爱威科技	250	7,847.50	0.00
104	300960	通业科技	332	7,806.84	0.00
105	300910	瑞丰新材	74	7,736.70	0.00
106	605123	派克新材	99	7,543.80	0.00
107	688660	电气风电	820	7,216.00	0.00
108	688681	科汇股份	379	6,966.02	0.00
109	301004	嘉益股份	315	6,934.98	0.00
110	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
111	300975	商络电子	517	6,872.51	0.00
112	300850	新强联	78	6,839.82	0.00
113	300967	晓鸣股份	561	6,749.88	0.00
114	300929	华骐环保	227	6,732.05	0.00
115	688367	工大高科	300	6,471.00	0.00
116	605089	味知香	70	6,091.40	0.00
117	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
118	003026	中晶科技	61	5,740.71	0.00
119	605337	李子园	88	5,236.00	0.00
120	605098	行动教育	89	5,008.03	0.00
121	301012	扬电科技	191	4,854.16	0.00
122	300890	翔丰华	86	4,695.60	0.00
123	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
124	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
125	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
126	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
127	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

128	603155	新亚强	87	3,957.63	0.00
129	300842	帝科股份	55	3,887.40	0.00
130	300858	科拓生物	51	3,884.67	0.00
131	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
132	002985	北摩高科	39	3,802.50	0.00
133	003020	立方制药	74	3,788.80	0.00
134	300855	图南股份	96	3,684.48	0.00
135	605305	中际联合	68	3,578.16	0.00
136	002982	湘佳股份	81	3,454.65	0.00
137	605117	德业股份	27	3,445.20	0.00
138	605259	绿田机械	95	3,386.75	0.00
139	300856	科思股份	67	3,370.77	0.00
140	605378	野马电池	73	3,353.62	0.00
141	300892	品渥食品	72	3,303.36	0.00
142	605389	长龄液压	56	3,286.08	0.00
143	605296	神农集团	69	3,256.80	0.00
144	002970	锐明技术	74	3,212.34	0.00
145	605009	豪悦护理	44	3,184.28	0.00
146	300860	锋尚文化	54	3,147.12	0.00
147	002984	森麒麟	86	3,134.70	0.00
148	002987	京北方	98	3,131.10	0.00
149	605180	华生科技	84	3,108.00	0.00
150	300922	天秦装备	87	3,030.21	0.00
151	300900	广联航空	79	2,953.02	0.00
152	300886	华业香料	91	2,951.13	0.00
153	605090	九丰能源	90	2,916.90	0.00
154	003023	彩虹集团	96	2,908.80	0.00
155	300868	杰美特	93	2,846.73	0.00
156	300881	盛德鑫泰	91	2,801.89	0.00
157	300908	仲景食品	47	2,800.73	0.00
158	605339	南侨食品	64	2,763.52	0.00
159	001207	联科科技	82	2,715.02	0.00
160	003032	传智教育	86	2,704.70	0.00
161	605077	华康股份	58	2,645.96	0.00
162	300913	兆龙互连	100	2,620.00	0.00
163	002989	中天精装	80	2,585.60	0.00
164	300872	天阳科技	71	2,577.30	0.00
165	300877	金春股份	69	2,537.13	0.00
166	001205	盛航股份	77	2,515.59	0.00
167	300851	交大思诺	73	2,460.83	0.00
168	003021	兆威机电	40	2,443.20	0.00
169	300903	科翔股份	75	2,404.50	0.00

170	605289	罗曼股份	80	2,307.20	0.00
171	003038	鑫铂股份	83	2,267.56	0.00
172	003030	祖名股份	80	2,252.80	0.00
173	601156	东航物流	90	2,130.30	0.00
174	605300	佳禾食品	76	2,112.80	0.00
175	300884	狄耐克	78	2,096.64	0.00
176	605136	丽人丽妆	67	2,038.81	0.00
177	003027	同兴环保	73	1,989.25	0.00
178	605286	同力日升	97	1,983.65	0.00
179	603565	中谷物流	65	1,937.65	0.00
180	300889	爱克股份	79	1,919.70	0.00
181	605007	五洲特纸	98	1,845.34	0.00
182	002983	芯瑞达	60	1,832.40	0.00
183	605298	必得科技	91	1,826.37	0.00
184	603511	爱慕股份	53	1,749.00	0.00
185	300837	浙矿股份	37	1,701.63	0.00
186	003010	若羽臣	62	1,684.54	0.00
187	300876	蒙泰高新	50	1,652.50	0.00
188	003028	振邦智能	32	1,651.20	0.00
189	605376	博迁新材	22	1,625.36	0.00
190	300887	谱尼测试	18	1,609.02	0.00
191	300845	捷安高科	70	1,596.00	0.00
192	300879	大叶股份	66	1,595.88	0.00
193	605003	众望布艺	66	1,542.42	0.00
194	605068	明新旭腾	41	1,474.77	0.00
195	605016	百龙创园	45	1,438.20	0.00
196	603931	格林达	44	1,414.16	0.00
197	003041	真爱美家	49	1,386.70	0.00
198	300824	北鼎股份	54	1,356.48	0.00
199	003009	中天火箭	23	1,335.84	0.00
200	001206	依依股份	21	1,333.92	0.00
201	605060	联德股份	83	1,309.74	0.00
202	300843	胜蓝股份	51	1,303.05	0.00
203	002988	豪美新材	97	1,300.77	0.00
204	003012	东鹏控股	78	1,297.92	0.00
205	003016	欣贺股份	81	1,296.81	0.00
206	605258	协和电子	40	1,286.00	0.00
207	605177	东亚药业	39	1,266.33	0.00
208	300840	酷特智能	85	1,247.80	0.00
209	003031	中瓷电子	22	1,203.40	0.00
210	300902	国安达	51	1,201.56	0.00
211	603324	盛剑环境	33	1,200.54	0.00

212	003036	泰坦股份	76	1,171.16	0.00
213	001202	炬申股份	59	1,158.76	0.00
214	605319	无锡振华	64	1,148.16	0.00
215	002993	奥海科技	26	1,132.30	0.00
216	605058	澳弘电子	48	1,129.92	0.00
217	605008	长鸿高科	59	1,129.26	0.00
218	003000	劲仔食品	84	1,119.72	0.00
219	300815	玉禾田	32	1,114.56	0.00
220	603529	爱玛科技	19	1,104.28	0.00
221	600916	中国黄金	71	1,101.92	0.00
222	605155	西大门	50	1,099.50	0.00
223	605500	森林包装	62	1,095.54	0.00
224	605366	宏柏新材	88	1,073.60	0.00
225	605050	福然德	97	1,048.57	0.00
226	002986	宇新股份	42	1,043.28	0.00
227	003001	中岩大地	41	1,033.20	0.00
228	300849	锦盛新材	72	1,031.76	0.00
229	605066	天正电气	78	1,028.82	0.00
230	605086	龙高股份	43	1,020.39	0.00
231	605099	共创草坪	24	1,017.12	0.00
232	003039	顺控发展	24	1,003.44	0.00
233	601512	中新集团	98	976.08	0.00
234	003037	三和管桩	74	973.84	0.00
235	605118	力鼎光电	67	959.44	0.00
236	300857	协创数据	34	949.28	0.00
237	600918	中泰证券	87	941.34	0.00
238	603408	建霖家居	62	918.84	0.00
239	002997	瑞鹄模具	51	915.96	0.00
240	300882	万胜智能	52	907.40	0.00
241	605186	健麾信息	26	891.28	0.00
242	002996	顺博合金	49	836.92	0.00
243	601686	友发集团	74	825.84	0.00
244	605299	舒华体育	38	817.38	0.00
245	003003	天元股份	56	797.44	0.00
246	601963	重庆银行	72	782.64	0.00
247	002990	盛视科技	24	776.64	0.00
248	300891	惠云钛业	43	747.77	0.00
249	605199	葫芦娃	26	746.98	0.00
250	300830	金现代	71	728.46	0.00
251	603836	海程邦达	33	720.06	0.00
252	605183	确成股份	41	717.50	0.00
253	605179	一鸣食品	39	699.27	0.00

254	601636	旗滨集团	37	686.72	0.00
255	605388	均瑶健康	30	682.80	0.00
256	300912	凯龙高科	17	665.89	0.00
257	605001	威奥股份	69	636.87	0.00
258	300911	亿田智能	9	623.52	0.00
259	605116	奥锐特	42	588.84	0.00
260	605169	洪通燃气	40	585.20	0.00
261	605268	王力安防	42	579.60	0.00
262	003042	中农联合	20	563.80	0.00
263	300846	首都在线	31	563.58	0.00
264	605189	富春染织	23	554.07	0.00
265	605005	合兴股份	34	553.52	0.00
266	688571	杭华股份	61	549.61	0.00
267	003013	地铁设计	24	547.20	0.00
268	600032	浙江新能	45	547.20	0.00
269	002998	优彩资源	53	537.42	0.00
270	605018	长华股份	40	528.40	0.00
271	605218	伟时电子	37	524.29	0.00
272	300847	中船汉光	31	504.06	0.00
273	003005	竞业达	12	469.68	0.00
274	601528	瑞丰银行	30	467.10	0.00
275	601702	华峰铝业	66	465.30	0.00
276	003035	南网能源	46	457.24	0.00
277	605255	天普股份	30	451.50	0.00
278	605055	迎丰股份	47	447.44	0.00
279	605488	福莱新材	16	427.04	0.00
280	605151	西上海	23	422.74	0.00
281	001208	华菱线缆	54	417.42	0.00
282	605318	法狮龙	28	410.76	0.00
283	605133	嵘泰股份	18	390.24	0.00
284	603759	海天股份	19	389.50	0.00
285	605338	巴比食品	12	387.96	0.00
286	600956	新天绿能	33	386.43	0.00
287	003029	吉大正元	16	381.44	0.00
288	605166	聚合顺	41	381.30	0.00
289	002999	天禾股份	46	356.50	0.00
290	001201	东瑞股份	8	327.52	0.00
291	002992	宝明科技	19	314.45	0.00
292	300833	浩洋股份	6	312.72	0.00
293	300893	松原股份	14	312.48	0.00
294	003018	金富科技	27	308.07	0.00
295	601187	厦门银行	29	274.92	0.00

296	601778	晶科科技	49	267.54	0.00
297	003002	壶化股份	21	259.14	0.00
298	605399	晨光新材	11	258.61	0.00
299	605088	冠盛股份	16	258.24	0.00
300	300831	派瑞股份	16	256.16	0.00
301	605006	山东玻纤	18	219.60	0.00
302	601827	三峰环境	23	217.81	0.00
303	603112	华翔股份	20	217.80	0.00
304	003025	思进智能	7	212.45	0.00
305	605303	园林股份	10	184.30	0.00
306	003004	声迅股份	6	168.90	0.00
307	001203	大中矿业	8	161.20	0.00
308	605228	神通科技	17	160.14	0.00
309	003022	联泓新科	5	153.50	0.00
310	605108	同庆楼	8	153.44	0.00
311	605277	新亚电子	7	147.21	0.00
312	605158	华达新材	17	140.93	0.00
313	300838	浙江力诺	9	140.49	0.00
314	300883	龙利得	11	133.98	0.00
315	603682	锦和商业	18	116.64	0.00
316	003006	百亚股份	4	94.80	0.00
317	605122	四方新材	3	80.10	0.00
318	601568	北元集团	7	59.92	0.00
319	605368	蓝天燃气	4	57.20	0.00
320	300878	维康药业	1	46.67	0.00
321	601279	英利汽车	4	41.72	0.00
322	300839	博汇股份	2	41.00	0.00
323	300853	申昊科技	1	38.40	0.00
324	003033	征和工业	1	31.69	0.00
325	003040	楚天龙	1	30.40	0.00
326	003019	宸展光电	1	27.06	0.00
327	605188	国光连锁	3	26.67	0.00
328	605208	永茂泰	1	21.83	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	300124	汇川技术	39,904,219.64	4.41
2	600745	闻泰科技	36,877,446.36	4.08
3	603236	移远通信	34,624,811.83	3.83
4	002351	漫步者	25,024,918.75	2.77

5	002920	德赛西威	23,565,944.64	2.61
6	688268	华特气体	22,234,616.82	2.46
7	000100	TCL 科技	21,917,630.06	2.42
8	002026	山东威达	20,936,966.00	2.31
9	002389	航天彩虹	20,441,723.47	2.26
10	300873	海晨股份	16,440,697.03	1.82
11	000049	德赛电池	14,412,753.70	1.59
12	603738	泰晶科技	14,104,464.60	1.56
13	002727	一心堂	13,959,751.00	1.54
14	300149	睿智医药	10,430,769.00	1.15
15	000639	西王食品	10,001,472.70	1.11
16	002891	中宠股份	9,829,111.95	1.09
17	600966	博汇纸业	8,461,390.00	0.94
18	000547	航天发展	8,220,528.00	0.91
19	300638	广和通	7,899,536.25	0.87
20	300415	伊之密	7,868,244.00	0.87

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	600031	三一重工	97,630,404.32	10.79
2	002027	分众传媒	73,285,339.04	8.10
3	002891	中宠股份	69,392,327.12	7.67
4	000951	中国重汽	60,276,660.71	6.66
5	601636	旗滨集团	47,773,843.03	5.28
6	300415	伊之密	46,417,965.00	5.13
7	300168	万达信息	42,825,381.00	4.73
8	603039	泛微网络	36,318,199.00	4.02
9	600486	扬农化工	30,365,883.00	3.36
10	600745	闻泰科技	29,912,941.32	3.31
11	300785	值得买	27,164,109.01	3.00
12	601919	中远海控	26,568,580.95	2.94
13	000100	TCL 科技	23,937,989.00	2.65
14	688981	中芯国际	20,757,820.72	2.29
15	603444	吉比特	17,810,716.46	1.97
16	300149	睿智医药	17,650,204.36	1.95
17	300724	捷佳伟创	12,888,442.00	1.42
18	002351	漫步者	11,449,889.00	1.27
19	300133	华策影视	10,560,987.00	1.17
20	000639	西王食品	9,588,299.00	1.06

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	425,270,275.78
卖出股票收入（成交）总额	827,989,612.57

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

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

无。

## 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

无。

## 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	188,823.18
2	应收证券清算款	16,050,703.16
3	应收股利	-
4	应收利息	3,333.87
5	应收申购款	370,105.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,612,966.20

## 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

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（%）
融通转型三动力灵活配置混合 A/B	63,446	2,508.28	9,604,551.71	6.04	149,535,870.65	93.96
融通转型三动力灵活配置混合 C	1,178	1,913.68	1,088,816.93	48.30	1,165,498.43	51.70
合计	64,624	2,497.44	10,693,368.64	6.63	150,701,369.08	93.37

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	133,494.60	0.08388
	融通转型三动力灵活配置混合 C	3.60	0.00016

有本基金	合计	133,498.20	0.08272
------	----	------------	---------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	0~10
	融通转型三动力灵活配置混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	0
	融通转型三动力灵活配置混合 C	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 1 月 16 日）基金份额总额	664,827,527.20	-
本报告期期初基金份额总额	285,293,361.74	12,040,440.33
本报告期基金总申购份额	39,158,986.08	4,759,977.87
减：本报告期基金总赎回份额	165,311,925.46	14,546,102.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	159,140,422.36	2,254,315.36

### § 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，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、托管人的托管业务部门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	
国金证券	1	181,642,191.85	14.63%	169,166.20	14.84%	-
天风证券	2	163,302,775.29	13.16%	148,827.93	13.05%	-
信达证券	2	138,252,156.54	11.14%	126,056.83	11.05%	-
中信证券	2	128,401,890.61	10.35%	117,023.30	10.26%	-
华创证券	2	110,165,190.20	8.88%	101,330.88	8.89%	-
长江证券	1	105,192,592.28	8.48%	95,855.78	8.41%	-
广发证券	1	100,869,938.56	8.13%	93,944.80	8.24%	-
东北证券	3	83,444,374.96	6.72%	76,042.35	6.67%	-
国海证券	2	68,553,233.35	5.52%	63,023.47	5.53%	-
招商证券	1	62,528,874.32	5.04%	58,235.88	5.11%	-
东方财富	1	38,064,361.08	3.07%	34,687.01	3.04%	-
东吴证券	2	24,949,095.65	2.01%	23,235.68	2.04%	-
华泰证券	1	24,594,828.12	1.98%	22,414.97	1.97%	-
兴业证券	1	11,229,252.28	0.90%	10,458.13	0.92%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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

本报告期内，本基金新增东兴证券 1 个交易单元；终止中金公司 1 个交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
国金证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	22,696.40	99.35%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	147.96	0.65%	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	关于东方财富证券股份有限公司销售的融通基金旗下部分开放式基金开通定期定额投资业务并参加其费率优惠活动	上海证券报、管理人网站	2021/1/15

	的公告		
2	融通关于旗下部分开放式基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并开通转换业务及参加其费率优惠的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/3/10
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/3/16
4	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/3/29
5	融通关于旗下部分开放式基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构和新增开通基金定期定额投资业务的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/3/30
6	融通关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富开通定投及参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/4/12
7	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/4/14
8	关于旗下部分开放式基金参与中国国际金融股份有限公司及中国中金财富证券有限公司费率优惠的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/4/27
9	融通关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/5/31
10	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/6/17
11	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与上海基煜基金销售有限公司费率优惠的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/6/24
12	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上海证券报、 管理人网站	2021/6/30

## § 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转型三动力灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- （二）《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《融通转型三动力灵活配置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

### 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