

融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金
2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 26 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新能源汽车主题精选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 2022 年 8 月 19 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
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	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	融通新能源汽车主题精选灵活配置混合	
基金主代码	005668	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 15 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	428,695,954.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通新能源汽车主题精选 A	融通新能源汽车主题精选 C
下属分级基金的交易代码	005668	009835
报告期末下属分级基金的 份额总额	394,620,772.11 份	34,075,182.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选投资与新能源汽车主题相关的优质证券，在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×70% + 中证香港 100 指数收益率×10% + 中债综合全价（总值）指数收益率×20%
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，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	张威	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	证券时报
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、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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 06 月 30 日)	
	融通新能源汽车主题精选 A	融通新能源汽车主题精选 C
本期已实现收益	-100,942,254.43	-21,163,212.26
本期利润	-219,301,513.68	-81,770,920.48
加权平均基金份额本期利润	-0.4795	-0.7738
本期加权平均净值利润率	-17.37%	-27.87%
本期基金份额净值增长率	-11.61%	-11.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	融通新能源汽车主题精选 A	融通新能源汽车主题精选 C
期末可供分配利润	579,451,565.60	49,098,915.21
期末可供分配基金份额利润	1.4684	1.4409
期末基金资产净值	1,183,230,599.32	101,227,960.65
期末基金份额净值	2.9984	2.9707
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	融通新能源汽车主题精选 A	融通新能源汽车主题精选 C
基金份额累计净值增长率	199.84%	60.58%

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

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

3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通新能源汽车主题精选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	14.43%	1.98%	16.96%	1.74%	-2.53%	0.24%
过去三个月	12.87%	2.48%	15.64%	2.03%	-2.77%	0.45%
过去六个月	-11.61%	2.26%	0.52%	1.97%	-12.13%	0.29%
过去一年	0.50%	2.05%	7.11%	1.88%	-6.61%	0.17%
过去三年	226.84%	1.90%	175.48%	1.72%	51.36%	0.18%
自基金合同生效起至今	199.84%	1.81%	120.70%	1.64%	79.14%	0.17%

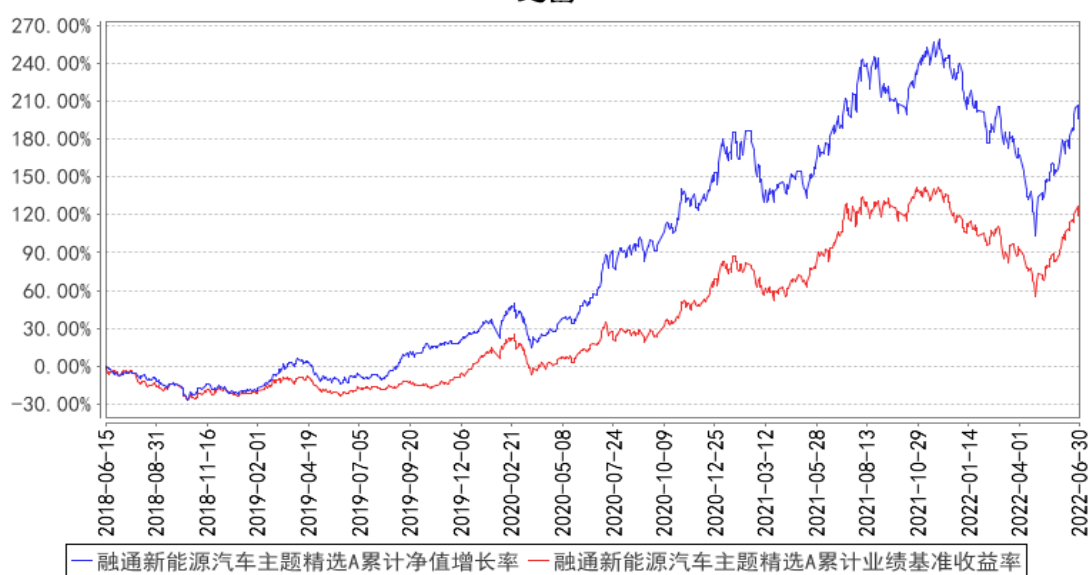
融通新能源汽车主题精选 C

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	14.38%	1.98%	16.96%	1.74%	-2.58%	0.24%
过去三个月	12.73%	2.48%	15.64%	2.03%	-2.91%	0.45%
过去六个月	-11.83%	2.26%	0.52%	1.97%	-12.35%	0.29%

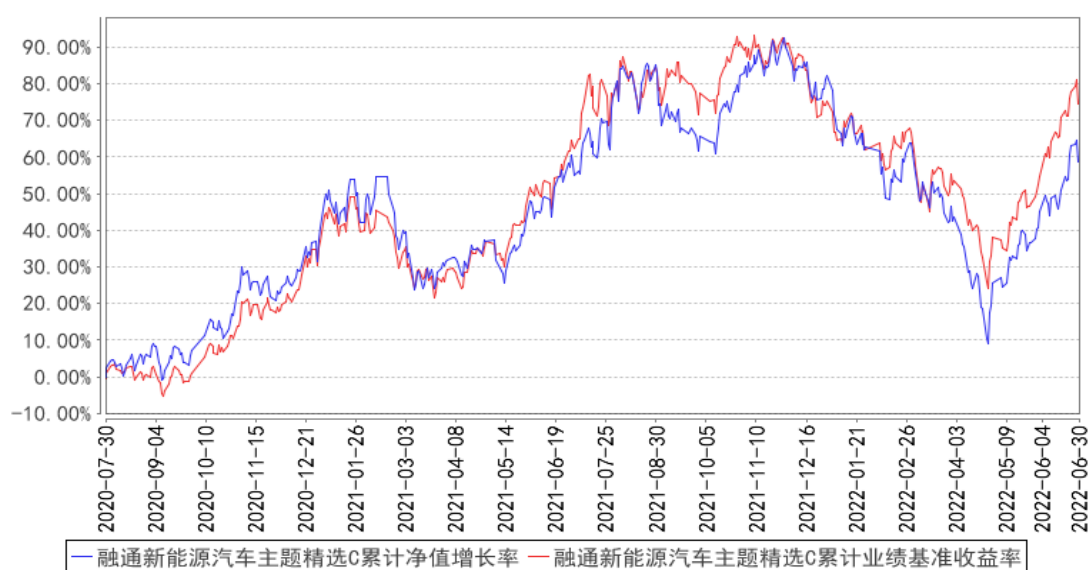
过去一年	-0.01%	2.05%	7.11%	1.88%	-7.12%	0.17%
自基金合同生效起至今	60.58%	2.01%	76.05%	1.79%	-15.47%	0.22%

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

融通新能源汽车主题精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通新能源汽车主题精选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 日增加 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：诚通证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 80 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

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股票型证券投资基金、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、融通多元收益一年持有期混合型证券投资基金、融通创新动力混合型证券投资基金、融通稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金、融通鑫新成长混合型证券投资基金、融通稳健增利 6 个月持有期混合型证券投资基金、融通稳信增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、融通先进制造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		
王迪	本基金的基金经理	2018 年 6 月 20 日	-	11	王迪先生，计量金融学硕士，11 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2011 年 4 月至 2014 年 10 月就职于信达澳银基金管理有限公司任行业研究员。2014 年 11 月加入融通基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员，现任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、融通先进制造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

本基金的组合配置思路：我们对整体的组合构建做了一定的迭代，以期更符合实际，契合自身能力与个性，包括保持一个良好的组合管理心态。组合主要分为三部分构成，相互之间随着时间推移可以互为转化。

一、基石配置。此部分为组合的基础，也是重仓的领域。选取的标的核心条件为行业市场空间大，竞争格局清晰，公司长期竞争力突出，业绩增长与估值较为匹配。此部分标的持有仓位较多，配置较为集中，并且持有期较长。

二、进攻配置。积极寻找可能成为股价领头羊的标的，这些标的存在一些鲜明的特征，如行业比较优势突出，行业逻辑发生重大积极变化，业绩爆发式增长，中长期不可证伪。当然另一面往往是估值较高，涨幅已经较大。这一部分我们会充分考虑市场环境，如流动性、风险偏好等做出配置比例调整。这部分的配置也可以很好的平衡其他两部分配置，能够让其他两部分更好的长期持有。

三、储备型配置。这部分主要为组合未来配置做好研究储备。这些标的的特点是低估值，公司竞争力很强但短期业绩或者行业逻辑遇到一些挑战。但我们认为困难是短期的，一旦挑战因素预期解决，预计标的将迎来业绩与估值双升，潜在空间较大。

基于目前的市场环境，我们认为市场流动性较为宽裕，疫情后政策托底经济动作应出尽出，大环境是积极向上的。所以我们在二季度末期增加了进攻性配置，减少了储备型配置，继续坚守

基石配置。

细分行业配置思路：

一、新能源车：继续看好动力电池、隔膜、锂电设备、汽车智能化、新能源功率半导体等环节中的龙头公司。这些个环节进入门槛相对较高，龙头公司优势显著。锂电设备环节市场存在一定争议，认为明年行业订单增长有一定压力，但就我们的认知，相对于市场更加乐观，所以会继续持有该环节。去年到今年碳酸锂环节价格不断上涨，遗憾的是我们在这部分的配置较少，主要我们认为长期来看，碳酸锂并不短缺，目前的暴利不可持续。并且经历过 2020 年开始的大幅上涨后，供给会加快开出，同时看到碳酸锂的价格已经成为下游不可承受之重，锂价的天花板已经越来越近。但实际锂的实际价格和股价走势依然超出了我们的预期。我们将对这个细分领域继续保持重点关注。对于下游的整车环节我们配置相对较少，主要是整车企业的市值、估值已经突破了我们的想象，在中国汽车销量整体增速有限的情况下，实际新老玩家的竞争非常激烈，竞争格局并不清晰。另外，我们对偏新能源的功率半导体持乐观态度，市场认为整体半导体行业景气度下行，但我们观察到偏新能源的功率半导体将持续在旺盛的下游拉动、有限的上游供给下，持续保持供不应求。

二、光伏风电。光伏领域我们认为今年超预期的是海外的分布式储能、逆变器需求（尤其是微型逆变器）以及光伏坩埚的原材料石英砂。在进攻型配置中，我们将上述子行业作为重点领域。风电中，我们继续看好风电轴承、海风电缆，这两个领域相对进入壁垒较高，优质公司的竞争力突出。

三、国防军工。该板块保持着较高的景气度，我们重点看好连接器、碳纤维、航空整机、芯片等子领域。军工板块目前估值合理，业绩保持较快增长，性价比仍然较高。同时，我们也看到优秀的军工公司在民品领域开始崭露头角，打开了更为广阔的民用市场空间，例如在新能源、大飞机等领域。

具体到本基金，主要以电动车等泛新能源作为主要配置方向。我将长期致力于配置符合产业趋势的、具备卓越属性的伟大公司，同时辅以阶段性的特色标的，并且做好未来标的和行业的战略储备。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通新能源汽车主题精选 A 基金份额净值为 2.9984 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.61%；截至本报告期末融通新能源汽车主题精选 C 基金份额净值为 2.9707 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.83%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观展望：

欧美经济环境堪忧，中国资产具有比较优势。一方面欧美通胀高企，持续加息，疫情期间泛滥的流动性持续显现负面影响，经济存在衰退的可能性。一方面俄乌战争等地缘冲突持续，在全球经济增长乏力的背景下，地缘冲突不排除频发的可能性。这两点都对全球投资人的风险偏好有负面影响。但同时我们也能看到，中国的大环境是平稳的，从历史来看相信我们这次能够应对疫情、房地产等带来的风险，总体中国资产的全球竞争力向好，全球比较优势越来越突出，所以我们在全球动荡的背景下，从比较优势思维来看，中国资产依然是最好的选择之一。

市场展望：

上海疫情解封之后，市场反弹明显。尤其是在流动性预期宽松的背景下，热门赛道、中小市值公司涨幅明显。目前看，热门赛道如新能源、军工等需求展望依然良好，其中的新技术也成为了市场热点，也出现了如家用服务机器人等新的主题性投资机会。但如果看待估值的话，很多大幅上涨的标的，尤其是一些长期竞争力存疑的标的，个人认为估值已经偏高。未来重点关注流动性的变化趋势，如果出现收缩态势，估值偏高的标的预计会有明显的估值收缩。对比来看，一些细分行业中的大市值龙头公司，短期也许因为市场风格原因出现滞涨，但这些标的的长期竞争力清晰，业绩稳定，估值具有比较优势，依然是我们配置的重点。

行业简述：

一、新能源车行业：疫情之后快速复苏。二季度新能源汽车行业经历了两个阶段。第一个阶段整个行业承压，主要由于原材料成本高企、终端车型被迫涨价传导压力、上海疫情造成正常的生产物流中断，以及消费者预期收入下降可能对汽车消费整体带来负面影响。第二阶段为行业复苏，主要由于疫情有效控制之后各地方政府出台了新能源汽车消费刺激政策，油价高位也进一步促进了新能源车渗透率提高，同时新能车的车型丰富度提升进一步满足了不同消费者需求。在疫情之后我们观察到了新能源车行业的恢复速度是较快的。我们对新能源车长期趋势较为乐观，消费者对于新能车的接受度已经明显提高，渗透率逐步提高已经势不可挡。但同时我们应该注意到未来可能存在的短期风险，如碳酸锂依然供不应求成为行业瓶颈，明年国家补贴将完全退坡对产业链盈利带来一定扰动，今年各地方出台的短期刺激政策也大多在今年底结束。明年上半年可能会在销量增速上，尤其是环比增速上呈现一定压力。

二、光伏风电行业：需求确定度高，明年展望乐观。在碳减排碳中和的大趋势下，光伏风电等新能源长期趋势明确。同时，今年由于俄乌战争造成传统能源价格大涨，进一步促使了海外新能源需求超出预期。短期看，光伏的需求由硅料的供给决定，由于海外需求超预期，硅料价格上

涨已经明显超出市场预期，造成组件价格高企，我们的观点是目前的组件价格预计将对国内外的地面电站装机带来负面影响，对收益率较好的国内户用、海外户用暂时影响不大。总体来看，今年将呈现分布式尤其是海外分布式超预期，地面电站或将承压的局面，总体今年的装机量预计能够符合市场预期的快速增长。预计在今年下半年到明年硅料的产能将有明显释放，行业需求将进一步实现较快增长。风电上半年招标量超出市场预期，无论是陆风还是海风招标都优于年初预期，同时原材料价格下降也有助于风电产业链的盈利改善。

三、国防军工行业：通过我们的观察，国防军工由于其计划性和生产区域分布，即使在疫情影响之下，受到的影响是相对较小的。在建设国防现代化的大背景下，国防军工十四五期间预期保持高景气度。我们认为国防军工具具有一个明晰的行业比较优势，就是细分行业竞争格局较为清晰，竞争态势相对可判断，所以盈利能力的稳定性较高。

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

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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	72,203,178.62	124,950,079.96
结算备付金		1,068,870.10	2,395,651.03
存出保证金		536,679.49	397,866.05
交易性金融资产	6.4.7.2	1,206,888,318.28	2,097,167,679.96
其中：股票投资		1,204,857,645.16	2,097,167,679.96
基金投资		-	-
债券投资		2,030,673.12	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		26,274,490.53	71,543.93
应收股利		-	-
应收申购款		4,121,322.22	1,524,377.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	15,757.33
资产总计		1,311,092,859.24	2,226,522,956.24
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		12,416,253.23	4,865,332.76
应付赎回款		10,367,329.02	4,909,376.95
应付管理人报酬		1,657,918.96	2,583,185.64
应付托管费		276,319.83	430,530.94
应付销售服务费		63,425.46	101,314.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7.73	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,853,045.04	2,132,336.13
负债合计		26,634,299.27	15,022,076.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	428,695,954.12	652,591,339.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	855,762,605.85	1,558,909,540.11
净资产合计		1,284,458,559.97	2,211,500,879.72
负债和净资产总计		1,311,092,859.24	2,226,522,956.24

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 428,695,954.12 份，其中融通新能源汽车主题精选 A 类基金份额为 394,620,772.11 份，基金份额净值 2.9984 元。融通新能源汽车主题精选 C 类基金份额为 34,075,182.01 份，基金份额净值 2.9707 元。

6.2 利润表

会计主体：融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-286,606,255.39	244,771,684.21
1. 利息收入		205,362.48	216,123.71
其中：存款利息收入	6.4.7.13	205,362.48	215,711.11
债券利息收入			412.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-109,577,322.03	293,849,448.24
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-114,225,908.75	286,149,453.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,161.63	273,301.21
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,647,425.09	7,426,693.36
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益			-
其他投资收益			-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-178,966,967.47	-55,121,753.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,732,671.63	5,827,865.66
减：二、营业总支出		14,466,178.77	21,316,390.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,662,346.59	12,274,647.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,943,724.44	2,045,774.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	739,522.49	562,057.27
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出			-
6. 信用减值损失	6.4.7.22		-
7. 税金及附加		4.17	1.46

8. 其他费用	6.4.7.23	120,581.08	6,433,909.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-301,072,434.16	223,455,293.91
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-301,072,434.16	223,455,293.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-301,072,434.16	223,455,293.91

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	652,591,339.61	-	1,558,909,540.11	2,211,500,879.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	652,591,339.61	-	1,558,909,540.11	2,211,500,879.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-223,895,385.49	-	-703,146,934.26	-927,042,319.75
（一）、综合收益总额	-	-	-301,072,434.16	-301,072,434.16
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-223,895,385.49	-	-402,074,500.10	-625,969,885.59
其中：1. 基金申购款	234,292,233.50	-	447,686,952.95	681,979,186.45
2. 基金	-458,187,618.99	-	-849,761,453.05	-1,307,949,072.04

赎回款				
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	428,695,954.12	-	855,762,605.85	1,284,458,559.97
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	695,564,501.52	-	1,115,282,531.83	1,810,847,033.35
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	695,564,501.52	-	1,115,282,531.83	1,810,847,033.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-172,350,407.86	-	-78,150,016.42	-250,500,424.28
(一)、综合收益总额	-	-	223,455,293.91	223,455,293.91
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-172,350,407.86	-	-301,605,310.33	-473,955,718.19
其中: 1. 基金申购款	525,325,698.60	-	857,536,750.91	1,382,862,449.51
2. 基金赎回款	-697,676,106.46	-	-1,159,142,061.24	-1,856,818,167.70

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	523,214,093.66	-	1,037,132,515.41	1,560,346,609.07

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

融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]20号《关于准予融通新能源汽车主题精选灵活配置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《融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 922,768,743.35 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0427 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2018 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 923,284,016.25 份基金份额,其中认购资金利息折合 515,272.90 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《融通基金管理有限公司关于融通新能源汽车主题精选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》及修改后的《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合同》的规定,本基金自 2020 年 7 月 29 日起进行份额分类,原有基金份额为 A 类份额,增设 C 类份额。原在投资者申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,转为 A 类基金份额;不收取申购费用、而是从本类别基金资产中计

提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》的有关规定，本基金的投资范围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（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）、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、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换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、权证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）占基金资产的比例为 0%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例占本基金股票资产的 0%-50%），投资于新能源汽车主题相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指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%。本基金业绩比较基准为：中证新能源汽车指数收益率×70% + 中证香港 100 指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%。

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》、《融通新能源汽车主题精选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 2022 年中期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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策除以下会计政策与最近一期年度报告不一致外，其余会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当

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

(3) 衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

预计收益率或票面利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。

6.4.5 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年中期财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 124,950,079.96 元、2,395,651.03 元、397,866.05 元、15,757.33 元、71,543.93 元和 1,524,377.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 124,964,272.46 元、2,397,018.07 元、398,063.84 元、0.00 元、71,543.93 元和 1,524,377.98 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，

金额为 2,097,167,679.96 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,097,167,679.96 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,865,332.76 元、4,909,376.95 元、2,583,185.64 元、430,530.94 元、101,314.10 元、1,904,558.15 元和 7,777.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,865,332.76 元、4,909,376.95 元、2,583,185.64 元、430,530.94 元、101,314.10 元、1,904,558.15 元和 7,777.98 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额（若有）均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息（若有）分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	72,203,178.62
等于：本金	72,194,392.48
加：应计利息	8,786.14
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	72,203,178.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,050,012,288.37	-	1,204,857,645.16	154,845,356.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,390,592.09	1,204.26	2,030,673.12	638,876.77
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,390,592.09	1,204.26	2,030,673.12	638,876.77
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,051,402,880.46	1,204.26	1,206,888,318.28	155,484,233.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	12,711.14
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	1,726,278.56
其中：交易所市场	1,726,278.56
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	114,055.34
合计	1,853,045.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通新能源汽车主题精选 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	557,034,363.40	557,034,363.40
本期申购	128,345,267.22	128,345,267.22
本期赎回（以“-”号填列）	-290,758,858.51	-290,758,858.51
基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	394,620,772.11	394,620,772.11

融通新能源汽车主题精选 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	95,556,976.21	95,556,976.21
本期申购	105,946,966.28	105,946,966.28
本期赎回（以“-”号填列）	-167,428,760.48	-167,428,760.48
基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	34,075,182.01	34,075,182.01

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

融通新能源汽车主题精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	940,397,709.05	392,107,432.27	1,332,505,141.32
本期利润	-100,942,254.43	-118,359,259.25	-219,301,513.68
本期基金份额交易产生的变动数	-260,003,889.02	-64,589,911.41	-324,593,800.43
其中：基金申购款	207,275,471.46	28,559,140.19	235,834,611.65
基金赎回款	-467,279,360.48	-93,149,051.60	-560,428,412.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	579,451,565.60	209,158,261.61	788,609,827.21

融通新能源汽车主题精选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	159,184,738.35	67,219,660.44	226,404,398.79
本期利润	-21,163,212.26	-60,607,708.22	-81,770,920.48
本期基金份额交易产生的变动数	-88,922,610.88	11,441,911.21	-77,480,699.67
其中：基金申购款	170,984,932.77	40,867,408.53	211,852,341.30
基金赎回款	-259,907,543.65	-29,425,497.32	-289,333,040.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,098,915.21	18,053,863.43	67,152,778.64

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	175,695.11
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	25,789.34
其他	3,878.03
合计	205,362.48

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-114,225,908.75
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	-114,225,908.75

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,229,489,643.30
减：卖出股票成本总额	2,337,554,194.50
减：交易费用	6,161,357.55
买卖股票差价收入	-114,225,908.75

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,161.63
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,161.63

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,647,425.09
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	4,647,425.09

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-178,966,967.47
股票投资	-179,605,844.24

债券投资	638,876.77
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	-178,966,967.47

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,477,282.20
基金转换费收入	255,389.43
合计	1,732,671.63

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% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中不低于转出基金赎回费用的 25% 的部分归入转出基金的基金财产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,525.74
合计	120,581.08

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

截至本财务报表批准日，本基金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

2022 年 4 月 13 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告》，中国证券监督管理委员会于 2022 年 3 月 24 日依法核准了中国诚通控股集团有限公司成为新时代证券股份有限公司主要股东、融通基金管理有限公司实际控制人。本次变更完成后，本基金管理人控股股东为新时代证券股份有限公司保持不变，本基金管理人实际控制人变更为中国诚通控股集团有限公司。2022 年 6 月 2 日，本基金管理人控股股东的公司名称由“新时代证券股份有限公司”变更为“诚通证券股份有限公司”。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,662,346.59	12,274,647.61
其中：支付销售机构的客户维护费	2,704,855.03	3,394,706.26

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,943,724.44	2,045,774.59

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通新能源汽车主题精选 A	融通新能源汽车主题精选 C	合计
	选 A	选 C	
融通基金	-	368,318.55	368,318.55
合计	-	368,318.55	368,318.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	融通新能源汽车主题精选 A	融通新能源汽车主题精选 C	合计
	选 A	选 C	
融通基金	-	137,406.86	137,406.86
合计	-	137,406.86	137,406.86

注：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 类基金份额的基金资产净值 × 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	72,203,178.62	175,695.11	213,608,997.38	191,512.31

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022 年 3 月 25 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏	2022 年	1-6 个	首发流	42.50	32.02	390	16,575.00	12,487.80	-

	眼科	3 月 14 日	月 (含)	通受限						
301103	何氏眼科	2022 年 6 月 1 日	1-6 个月 (含)	送股流通受限	-	32.02	117	-	3,746.34	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	34.81	16.14	1,225	42,642.25	19,771.50	-
301109	军信股份	2022 年 6 月 17 日	1-6 个月 (含)	送股流通受限	-	16.14	613	-	9,893.82	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301122	采纳股份	2022 年 1 月 19 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	22.55	37.7	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022 年 4 月 1 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-

301139	元道通信	2022年6月30日	1-6个月(含)	首发流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	首发流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	1-6个月(含)	首发流通受限	38.39	23.9	516	19,809.24	12,332.40	-
301150	中一科技	2022年4月14日	1-6个月(含)	首发流通受限	163.56	82.76	160	26,169.60	13,241.60	-
301150	中一科技	2022年6月10日	1-6个月(含)	送股流通受限	-	82.76	80	-	6,620.80	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	1-6个月(含)	首发流通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022年5月10日	1-6个月(含)	首发流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022年1月7日	1-6个月(含)	首发流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	1-6个月(含)	首发流通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	1-6个月(含)	首发流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301175	中科环保	2022年6月30日	1-6个月(含)	首发流通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	首发流通受限	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	1-6个月(含)	首发流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	1-6个月(含)	首发流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	1-6个月(含)	首发流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-

		日								
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	173.98	87.82	281	48,888.38	24,677.42	-
301219	腾远钴业	2022 年 5 月 24 日	1-6 个月 (含)	送股流通受限	-	87.82	225	-	19,759.50	-
301220	亚香股份	2022 年 6 月 15 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301236	软通	2022 年	1-6 个	首发流	72.88	31.38	1,328	96,784.64	41,672.64	-

	动力	3 月 8 日	月(含)	通受限						
301236	软通动力	2022 年 6 月 9 日	1-6 个月(含)	送股流通受限	-	31.38	664	-	20,836.32	-
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内(含)	首发流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	1-6 个月(含)	首发流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-

301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688115	思林杰	2022 年 3 月 7 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	65.65	38.46	2,153	141,344.45	82,804.38	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	30.99	30.99	4,264	132,141.36	132,141.36	-
688348	昱能科技	2022 年 5 月 31 日	1-6 个月 (含)	首发流通受限	163.00	416.57	5,644	919,972.00	2,351,121.08	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内 (含)	首发流通受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、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。

4、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。

5、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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。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，通过可靠的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的各类重大风险，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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款（若有）存放在本基金的托管人中国建设银行；其他定期存款（若有）存放在具有存款资格的商业银行，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 2022 年 6 月 30 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 0.16%(2021 年 12 月 31 日：无)。

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 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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 2022 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 2022 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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	72,203,178.62	-	-	-	72,203,178.62
结算备付金	1,068,870.10	-	-	-	1,068,870.10
存出保证金	536,679.49	-	-	-	536,679.49
交易性金融资产	2,030,673.12	-	-	1,204,857,645.16	1,206,888,318.28
应收申购款	-	-	-	4,121,322.22	4,121,322.22

应收清算款	-	-	-	26,274,490.53	26,274,490.53
资产总计	75,839,401.33	-	-	1,235,253,457.91	1,311,092,859.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,367,329.02	10,367,329.02
应付管理人报酬	-	-	-	1,657,918.96	1,657,918.96
应付托管费	-	-	-	276,319.83	276,319.83
应付清算款	-	-	-	12,416,253.23	12,416,253.23
应付销售服务费	-	-	-	63,425.46	63,425.46
应交税费	-	-	-	7.73	7.73
其他负债	-	-	-	1,853,045.04	1,853,045.04
负债总计	-	-	-	26,634,299.27	26,634,299.27
利率敏感度缺口	75,839,401.33	-	-	1,208,619,158.64	1,284,458,559.97
上年度末 2021 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	124,950,079.96	-	-	-	124,950,079.96
结算备付金	2,395,651.03	-	-	-	2,395,651.03
存出保证金	397,866.05	-	-	-	397,866.05
交易性金融资产	-	-	-	2,097,167,679.96	2,097,167,679.96
应收申购款	-	-	-	1,524,377.98	1,524,377.98
应收证券清算款	-	-	-	71,543.93	71,543.93
其他资产	-	-	-	15,757.33	15,757.33
资产总计	127,743,597.04	-	-	2,098,779,359.20	2,226,522,956.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,909,376.95	4,909,376.95
应付管理人报酬	-	-	-	2,583,185.64	2,583,185.64
应付托管费	-	-	-	430,530.94	430,530.94
应付证券清算款	-	-	-	4,865,332.76	4,865,332.76
应付销售服务费	-	-	-	101,314.10	101,314.10
其他负债	-	-	-	2,132,336.13	2,132,336.13
负债总计	-	-	-	15,022,076.52	15,022,076.52
利率敏感度缺口	127,743,597.04	-	-	2,083,757,282.68	2,211,500,879.72

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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.16% (2021 年 12 月 31 日：无)，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（2021 年 12 月 31 日：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 2022 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				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 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	-	69,759,430.72	-	69,759,430.72
资产合计	-	69,759,430.72	-	69,759,430.72
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	69,759,430.72	-	69,759,430.72

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		
	相关风险变量的	对资产负债表日基金资产净值的	

	变动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	-	3,487,971.54
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-	-3,487,971.54

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的股票，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。本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 0%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例占本基金股票资产的 0%-50%），投资于新能源汽车主题相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,204,857,645.16	93.80	2,097,167,679.96	94.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,204,857,645.16	93.80	2,097,167,679.96	94.83

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证新能源汽车指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 中证新能源汽车指数收益率上升 5%	50,935,519.13	76,944,259.45
	2. 中证新能源汽车指数收益率下降 5%	-50,935,519.13	-76,944,259.45

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,200,833,281.18	2,093,341,782.41
第二层次	1,258,447.77	380,229.35
第三层次	4,796,589.33	3,445,668.20

合计	1,206,888,318.28	2,097,167,679.96
----	------------------	------------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,204,857,645.16	91.90
	其中：股票	1,204,857,645.16	91.90
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,030,673.12	0.15
	其中：债券	2,030,673.12	0.15
	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	73,272,048.72	5.59
8	其他各项资产	30,932,492.24	2.36
9	合计	1,311,092,859.24	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	1,332,303.44	0.10
C	制造业	1,102,245,440.94	85.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,677,815.00	7.84
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	53,749.33	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	297,354.82	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.02
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,204,857,645.16	93.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	300450	先导智能	1,877,867	118,643,637.06	9.24
2	002179	中航光电	1,801,181	114,050,780.92	8.88
3	300750	宁德时代	199,975	106,786,650.00	8.31
4	603290	斯达半导	273,800	105,659,420.00	8.23
5	002812	恩捷股份	391,861	98,141,587.45	7.64
6	300496	中科创达	554,800	72,390,304.00	5.64
7	601012	隆基绿能	793,776	52,889,294.88	4.12

8	300850	新强联	592,830	52,779,654.90	4.11
9	688348	昱能科技	108,508	52,548,753.08	4.09
10	603688	石英股份	376,350	49,907,773.50	3.89
11	300777	中简科技	875,530	42,200,546.00	3.29
12	688032	禾迈股份	45,861	39,944,931.00	3.11
13	600862	中航高科	1,418,079	39,848,019.90	3.10
14	603606	东方电缆	499,682	38,275,641.20	2.98
15	000738	航发控制	1,069,701	30,058,598.10	2.34
16	688052	纳芯微	73,695	27,927,457.20	2.17
17	300699	光威复材	471,380	27,750,140.60	2.16
18	688063	派能科技	87,703	27,380,876.60	2.13
19	688268	华特气体	314,254	22,079,486.04	1.72
20	002466	天齐锂业	148,828	18,573,734.40	1.45
21	601689	拓普集团	222,940	15,255,784.20	1.19
22	002756	永兴材料	90,000	13,698,900.00	1.07
23	688116	天奈科技	67,216	11,391,767.68	0.89
24	300763	锦浪科技	40,185	8,559,405.00	0.67
25	002006	精功科技	268,550	7,983,991.50	0.62
26	002415	海康威视	176,200	6,378,440.00	0.50
27	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.10
28	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02
29	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
30	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
31	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
32	688322	奥比中光	4,264	132,141.36	0.01
33	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
34	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.01
35	688115	思林杰	2,153	82,804.38	0.01
36	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
37	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
38	301236	软通动力	1,992	62,508.96	0.00
39	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
40	301219	腾远钴业	506	44,436.92	0.00
41	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
42	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
43	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
44	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
45	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
46	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
47	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
48	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
49	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00

50	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
51	301150	中一科技	240	19,862.40	0.00
52	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
53	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
54	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
55	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
56	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
57	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
58	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
59	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
60	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
61	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
62	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
63	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
64	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
65	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
66	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
67	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
68	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
69	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
70	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
71	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
72	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
73	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
74	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
75	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
76	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
77	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
78	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
79	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
80	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
81	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
82	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
83	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
84	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
85	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
86	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
87	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
88	301279	金道科技	296	6,751.76	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	603290	斯达半导	149,436,901.90	6.76
2	300496	中科创达	84,735,977.70	3.83
3	601012	隆基绿能	70,777,587.04	3.20
4	300750	宁德时代	60,318,983.78	2.73
5	300763	锦浪科技	58,118,416.00	2.63
6	002273	水晶光电	55,893,570.55	2.53
7	688348	昱能科技	48,461,474.69	2.19
8	600660	福耀玻璃	48,231,827.58	2.18
9	002050	三花智控	48,200,266.34	2.18
10	600862	中航高科	48,050,906.48	2.17
11	002415	海康威视	47,819,470.13	2.16
12	002812	恩捷股份	44,347,832.59	2.01
13	002179	中航光电	43,007,643.70	1.94
14	300699	光威复材	41,113,627.00	1.86
15	603688	石英股份	40,522,810.81	1.83
16	688599	天合光能	38,350,613.55	1.73
17	688032	禾迈股份	35,749,466.69	1.62
18	002756	永兴材料	35,711,472.60	1.61
19	000733	振华科技	35,055,895.00	1.59
20	688052	纳芯微	34,405,256.04	1.56

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	600660	福耀玻璃	116,235,648.27	5.26
2	300750	宁德时代	101,091,996.00	4.57
3	300274	阳光电源	98,155,253.47	4.44
4	688268	华特气体	93,401,611.63	4.22
5	002179	中航光电	89,119,452.80	4.03
6	300450	先导智能	85,333,362.67	3.86
7	002812	恩捷股份	62,939,270.40	2.85
8	603267	鸿远电子	62,810,833.44	2.84
9	002050	三花智控	60,757,564.29	2.75
10	603290	斯达半导	60,713,531.80	2.75
11	300699	光威复材	57,831,194.97	2.62
12	601012	隆基绿能	57,322,233.04	2.59

13	600760	中航沈飞	53,607,775.80	2.42
14	002273	水晶光电	52,473,634.91	2.37
15	601689	拓普集团	50,571,682.90	2.29
16	02333	长城汽车	29,900,443.81	1.35
17	601633	长城汽车	20,167,266.06	0.91
18	300763	锦浪科技	49,326,153.72	2.23
19	300088	长信科技	48,713,808.02	2.20
20	002756	永兴材料	45,340,103.60	2.05

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	1,624,850,003.94
卖出股票收入（成交）总额	2,229,489,643.30

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,030,673.12	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,030,673.12	0.16

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123137	锦浪转债	8,286	1,255,351.47	0.10
2	113053	隆 22 转债	5,620	775,321.65	0.06

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 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	536,679.49
2	应收清算款	26,274,490.53
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	4,121,322.22
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	30,932,492.24

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688348	昱能科技	2,351,121.08	0.18	首发流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
融通新能源汽车主题精选 A	81,482	4,843.04	152,383,415.24	38.62	242,237,356.87	61.38
融通新能源汽车主题精选 C	14,216	2,396.96	16,011,664.28	46.99	18,063,517.73	53.01
合计	95,698	4,479.68	168,395,079.52	39.28	260,300,874.60	60.72

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通新能源汽车主题精选 A	274,699.08	0.06961
	融通新能源汽车主题精选 C	4,216.05	0.01237
	合计	278,915.13	0.06506

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	融通新能源汽车主题精选 A	0
	融通新能源汽车主题精选 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通新能源汽车主题精选 A	10~50
	融通新能源汽车主题精选 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通新能源汽车主题精选 A	融通新能源汽车主题精选 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 15 日）基金份额总额	923,284,016.25	—
本报告期期初基金份额总额	557,034,363.40	95,556,976.21
本报告期基金总申购份额	128,345,267.22	105,946,966.28
减：本报告期基金总赎回份额	290,758,858.51	167,428,760.48
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	394,620,772.11	34,075,182.01

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

2022 年 5 月 30 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本基金管理人董事长由高峰变更为张威，上述变更事项经本基金管理人股东会 2022 年第一次临时会议、第六届董事会第十九次临时会议审议并通过。

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），该事务所自本基金合同生效以来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 (%)	
光大证券	2	626,115,563.42	16.36	571,615.87	16.58	-
东吴证券	2	513,686,170.72	13.42	473,261.88	13.73	-
德邦证券	2	425,105,108.52	11.11	389,267.47	11.29	-
东北证券	3	420,017,285.93	10.98	385,418.66	11.18	-
中金公司	2	340,152,144.71	8.89	309,989.31	8.99	-
招商证券	1	286,087,180.13	7.48	229,526.10	6.66	-
五矿证券	2	258,551,670.16	6.76	235,614.78	6.83	-
信达证券	2	204,945,632.44	5.36	186,763.56	5.42	-
中信建投	1	204,131,434.63	5.33	188,070.05	5.46	-
银河证券	1	201,950,134.24	5.28	185,633.39	5.38	-
华创证券	2	169,598,641.09	4.43	154,565.15	4.48	-
东方证券	1	91,734,796.49	2.40	83,589.99	2.42	-
中信证券	3	53,683,143.34	1.40	25,569.26	0.74	-
天风证券	2	30,824,517.46	0.81	28,398.39	0.82	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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，新时代证券更名为诚通证券。

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	成交金额	占当期债券回 购成交总额的	成交金额	占当期权证 成交总额的

		比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
光大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	828,600.00	59.59	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	562,000.00	40.41	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

诚通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分开放式基金新增万联证券为销售机构并开通定期定额申购、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 2 月 10 日
2	融通基金管理有限公司关于参加平安证券股份有限公司前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 2 月 21 日
3	关于融通旗下部分基金新增广发证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 31 日
4	融通关于旗下部分开放式基金新增北京中植基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 6 日
5	融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 13 日
6	关于旗下部分基金新增华泰证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 6 日
7	融通旗下部分开放式基金新增宁波银行为销售机构并开通定投、转换及参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 16 日
8	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增博时财富为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 24 日
9	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 30 日
10	融通基金管理有限公司关于公司股东名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 6 月 10 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022 年 4 月 13 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告》，中国证券监督管理委员会于 2022 年 3 月 24 日依法核准了中国诚通控股集团有限公司成为新时代证券股份有限公司主要股东、融通基金管理有限公司实际控制人。本次变更完成后，本基金管理人控股股东为新时代证券股份有限公司保持不变，本基金管理人实际控制人变更为中国诚通控股集团有限公司。2022 年 6 月 2 日，本基金管理人控股股东的公司名称由“新

时代证券股份有限公司”变更为“诚通证券股份有限公司”。

2022 年 5 月 30 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本基金管理人董事长由高峰变更为张威，上述变更事项经本基金管理人股东会 2022 年第一次临时会议、第六届董事会第十九次临时会议审议并通过。

2022 年 7 月，经本基金管理人股东会表决通过，股东诚通证券股份有限公司提名的罗林先生、罗小平先生任公司董事，股东日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd）提名的吕秋梅女士任公司董事；宗文龙先生、李曙光先生、席德应先生任公司独立董事。王利先生、律磊先生、大柳雄二（Yuji Ooyagi）先生不再担任公司董事；杜婕女士、施天涛先生、田利辉先生不再担任公司独立董事。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- （二）《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合同》
- （三）《融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《融通新能源汽车主题精选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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2022 年 8 月 26 日