

融通动力先锋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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通动力先锋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

<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
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
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>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（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>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通动力先锋混合型证券投资基金
基金简称	融通动力先锋混合
基金主代码	161609
前端交易代码	161609
后端交易代码	161659
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 15 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	392,191,287.86 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为主动式混合型基金，主要投资于制造业和服务行业中价值暂时被市场低估的股票，分享中国工业化深化过程中两大推动经济增长的引擎——“制造业（特别是装备制造业）和服务业（特别是现代服务业）”的高速成长，力争在控制风险并保持良好流动性的前提下，追求稳定的、优于业绩基准的回报，为投资者实现基金资产稳定且丰厚的长期资本增值。
投资策略	在遵守有关法律、法规和本基金合同的有关规定的的前提下，本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合、互相印证的投资策略，贯彻基金管理人“识别风险、管理风险”的投资理念。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518053	100140
法定代表人		张威	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-96,298,036.60
本期利润	-59,671,959.84
加权平均基金份额本期利润	-0.1510
本期加权平均净值利润率	-8.11%
本期基金份额净值增长率	-7.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	372,668,726.36
期末可供分配基金份额利润	0.9502
期末基金资产净值	764,860,014.22
期末基金份额净值	1.950
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	267.19%

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损益；

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

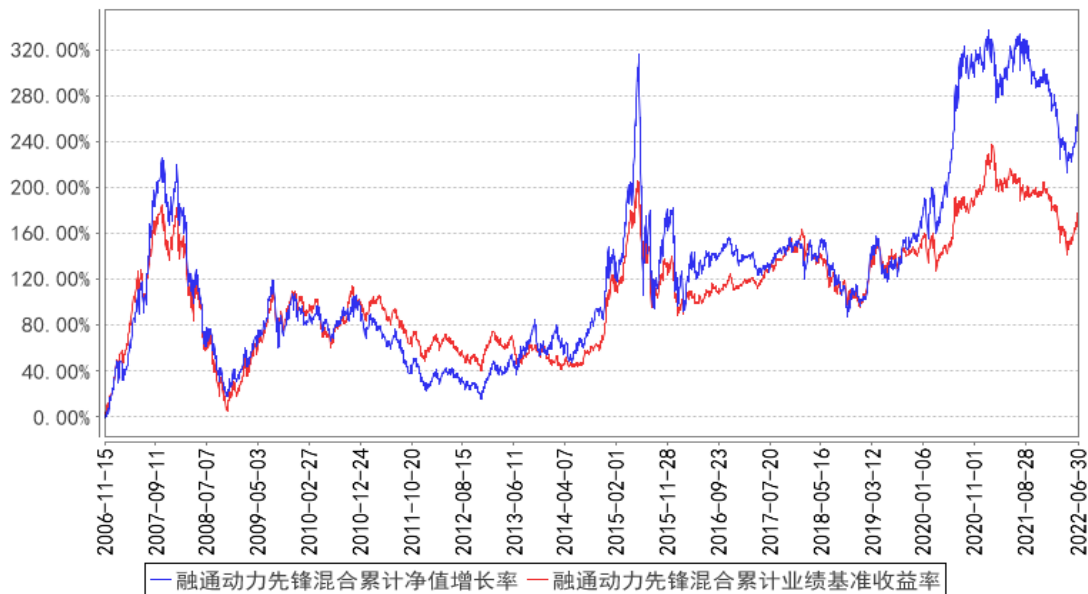
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.49%	0.91%	7.60%	0.86%	1.89%	0.05%
过去三个月	8.33%	1.26%	5.11%	1.15%	3.22%	0.11%

过去六个月	-7.10%	1.25%	-7.19%	1.16%	0.09%	0.09%
过去一年	-14.17%	1.14%	-10.90%	1.00%	-3.27%	0.14%
过去三年	56.90%	1.31%	15.47%	1.01%	41.43%	0.30%
自基金合同生效起至今	267.19%	1.65%	176.85%	1.36%	90.34%	0.29%

### 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

融通动力先锋混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中 2013 年 6 月 30 日之前（含此日）采用“富时中国 A600 指数收益率×80%+新华巴克莱资本中国全债指数收益率×20%”，2013 年 7 月 1 日起使用新基准即“沪深 300 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%”。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：诚通证券股份有限公司 60%、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		
关山	本基金的基金经理、研究部副总监	2021/2/18	-	16	关山女士，金融学硕士，16 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2006 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任纺织服装行业研究员、餐饮旅游行业研究员、轻工制造行业研究员、消费行业研究组组长、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通消费升级混合型证券投资基金基金经理，现任研究部副总监、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通动力先锋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

2022 年市场开年即震荡下行，基于对全年经济增长的担心，叠加高企的油价及海外形式的不确定，担忧情绪愈演愈烈。3 月后深圳，上海等地为代表的疫情加剧，生产生活均出现较为明显的影响。虽然国家出台一系列的稳增长措施，但是由于效果尚未显现，市场信心仍显不足。4 月底开始随后两个月的反弹超出市场预期，虽然海外通胀及经济的担心并未缓解，但是国内部分行业数据及政策给予市场的信心，使得风险偏好提升较快。当前复工复产已基本恢复正常，虽然疫情仍有点状发生，但处于完全可控的状态。

我们的组合在 1 季度控制了一定回撤，但是 2 季度基金反弹并不算多，主要原因是成长股的配置偏少。组合主要聚焦消费，农业，和部分金融股。我们组合中对疫后消费场景恢复端较为重视，包括旅游，餐饮链，及医疗消费服务，但是对于政策阶段性刺激的汽车消费有所忽视。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.950 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.10%，业绩比较基准收益率为-7.19%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年我们对国内经济修复存在比较强的信心：首先以房地产新老基建为代表的投资端受益于政策托底及专项债发行带来实物工作量的落地，都将在数据及预期层面有所转变；疫情精准防控后，消费场景逐步回归，对于整个消费服务市场形成较强拉动；同时一些消费券等额外政策推出，也将提振部分居民需求。

关于组合构建，接下来对于上市公司 2 季度业绩及后续下半年趋势变化有望成为市场关注点，我们也将结合报表对相关公司进行甄选。

#### 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、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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：融通动力先锋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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	84,579,647.67	122,402,266.01
结算备付金		1,518,841.74	4,363,049.91
存出保证金		346,935.28	334,665.91
交易性金融资产	6.4.7.2	690,884,203.40	734,172,269.09
其中：股票投资		690,884,203.40	734,172,269.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,513.54	6,091.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	12,941.65
资产总计		777,333,141.63	861,291,284.13
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		9,849,237.06	20,063,778.41
应付赎回款		90,550.39	384,538.20
应付管理人报酬		885,227.92	1,073,029.27

应付托管费		147,537.99	178,838.22
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,500,574.05	2,529,258.07
负债合计		12,473,127.41	24,229,442.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	392,191,287.86	398,853,953.58
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	372,668,726.36	438,207,888.38
净资产合计		764,860,014.22	837,061,841.96
负债和净资产总计		777,333,141.63	861,291,284.13

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.950 元，基金份额总额 392,191,287.86 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通动力先锋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
<b>一、营业总收入</b>		-53,167,037.56	40,304,025.40
1. 利息收入		209,755.07	302,184.73
其中：存款利息收入	6.4.7.13	209,755.07	286,042.37
债券利息收入		-	1,993.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	14,149.18
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-90,005,212.67	77,216,447.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-97,107,548.73	67,794,363.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	333,915.42
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	7,102,336.06	9,088,169.06
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	6.4.7.20	36,626,076.76	-37,326,441.46
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.21	2,343.28	111,834.20
<b>减：二、营业总支出</b>		6,504,922.28	16,141,509.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,478,314.46	7,199,636.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	913,052.47	1,199,939.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		-	7.23
8. 其他费用	6.4.7.23	113,555.35	7,741,925.86
<b>三、利润总额</b>		-59,671,959.84	24,162,516.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-59,671,959.84	24,162,516.37
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-59,671,959.84	24,162,516.37

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通动力先锋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)	398,853,953.58	-	438,207,888.38	837,061,841.96
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)	398,853,953.58	-	438,207,888.38	837,061,841.96
三、本期增减变动额	-6,662,665.72	-	-65,539,162.02	-72,201,827.74
(一)、综合收益总额	-	-	-59,671,959.84	-59,671,959.84
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数	-6,662,665.72	-	-5,867,202.18	-12,529,867.90
其中：1. 基金申购款	1,928,849.06	-	1,632,562.49	3,561,411.55
2. 基金赎回款	-8,591,514.78	-	-7,499,764.67	-16,091,279.45
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产	-	-	-	-

生的基金净值变动				
(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)	392,191,287.86	-	372,668,726.36	764,860,014.22
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)	536,993,203.49	-	656,451,114.36	1,193,444,317.85
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)	536,993,203.49	-	656,451,114.36	1,193,444,317.85
三、本期增减变动额	-105,125,462.33	-	-107,044,251.83	-212,169,714.16
(一)、综合收益总额	-	-	24,162,516.37	24,162,516.37
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数	-105,125,462.33	-	-131,206,768.20	-236,332,230.53
其中：1. 基金申购款	4,666,374.85	-	5,510,765.56	10,177,140.41
2. 基金赎回款	-109,791,837.18	-	-136,717,533.76	-246,509,370.94
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动	-	-	-	-
(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)	431,867,741.16	-	549,406,862.53	981,274,603.69

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

融通动力先锋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”)证监基金字[2006]第 183 号《关于同意融通动力先锋股票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《融通动力先锋股票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 3,363,270,255.72 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 167 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通动力先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,364,280,448.23 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,010,192.51 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,融通动力先锋股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为融通动力先锋混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通动力先锋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(含存托凭证)、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例(含存托凭证)为基金总资产的 60%-95%,其中低于 80%投资于制造业和服务业的上市公司。债券为 0%-40%,权证的投资比例为基金净资产的 0%-3%,并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的原业绩比较基准为:富时中国 A600 指数(原新华富时 A600 指数)收益率 $\times$ 80%+新华巴克莱资本中国全债指数(原新华雷曼中国全债指数)收益率 $\times$ 20%。根据本基金的基金管理人于 2013 年 6 月 28 日发布的《关于变更融通动力先锋股票型证券投资基金业绩比较基准及修改基金合同的公告》,自 2013 年 7 月 1 日起,本基金业绩比较基准变更为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 80%+中债综合指数收益率 $\times$ 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》、《融通动力先锋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商业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商业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(主要为股票投资)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。

金融资产和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、应收利息和应收申购款，金额分别为 122,402,266.01 元、4,363,049.91 元、334,665.91 元、12,941.65 元和 6,091.56 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-应收利息和应收申购款，金额分别为 122,413,093.66 元、4,365,013.31 元、334,816.51 元、0.00 元和 6,091.56 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 734,172,269.09 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 734,172,269.09 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、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 20,063,778.41 元、384,538.20 元、1,073,029.27 元、178,838.22 元、2,054,678.83 元和 250,079.24 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、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 20,063,778.41 元、384,538.20 元、1,073,029.27 元、178,838.22 元、2,054,678.83 元和 250,079.24 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（如有）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（如有）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	84,579,647.67
等于：本金	84,572,159.17
加：应计利息	7,488.50
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	84,579,647.67

#### 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	639,058,584.41	-	690,884,203.40	51,825,618.99
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	639,058,584.41	-	690,884,203.40	51,825,618.99

#### 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	250,000.00
应付赎回费	58.32
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,141,877.38
其中：交易所市场	1,141,877.38

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	108,638.35
合计	1,500,574.05

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	398,853,953.58	398,853,953.58
本期申购	1,928,849.06	1,928,849.06
本期赎回	-8,591,514.78	-8,591,514.78
本期末	392,191,287.86	392,191,287.86

注：申购含红利再投、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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	545,454,203.20	-107,246,314.82	438,207,888.38
本期利润	-96,298,036.60	36,626,076.76	-59,671,959.84
本期基金份额交易产生的变动数	-8,216,992.92	2,349,790.74	-5,867,202.18
其中：基金申购款	2,380,050.48	-747,487.99	1,632,562.49
基金赎回款	-10,597,043.40	3,097,278.73	-7,499,764.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	440,939,173.68	-68,270,447.32	372,668,726.36

#### 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	182,785.99
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	24,032.05
其他	2,937.03
合计	209,755.07

#### 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	-97,107,548.73
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	-97,107,548.73

#### 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	1,818,095,501.76
减：卖出股票成本总额	1,909,708,159.26
减：交易费用	5,494,891.23
买卖股票差价收入	-97,107,548.73

#### 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

无。

##### 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	7,102,336.06
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	7,102,336.06

## 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	36,626,076.76
股票投资	36,626,076.76
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	36,626,076.76

#### 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	1,829.06
基金转换费收入	514.22
合计	2,343.28

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、本基金的转换费用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。

#### 6.4.7.22 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	417.00
账户维护费	9,000.00
合计	113,555.35

#### 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

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	5,478,314.46	7,199,636.52
其中：支付销售机构的客户维护费	1,996,613.83	2,621,383.14

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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	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	913,052.47	1,199,939.42

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 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		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		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
中国工商银行	84,579,647.67	182,785.99	114,784,455.13	248,855.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022-1-6	1-6个月(含)	首发流通受限	55.57	30.03	513	28,507.41	15,405.39	-
301097	天益医疗	2022-3-25	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	2022-3-15	1-6个月(含)	首发流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022-3-14	1-6个月(含)	首发流通受限	42.50	32.02	390	16,575.00	12,487.80	-
301103	何氏眼科	2022-6-1	1-6个月(含)	送股流通受限	-	32.02	117	-	3,746.34	-
301109	军信股份	2022-4-6	1-6个月(含)	首发流通受限	34.81	16.14	919	31,990.39	14,832.66	-
301109	军信股份	2022-6-17	1-6个月(含)	送股流通受限	-	16.14	460	-	7,424.40	-
301110	青木股份	2022-3-4	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	2022-6-20	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	2022-1-10	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	2022-1-7	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	2022-4-11	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	2022-1-19	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	2022-1-14	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	2022-5-27	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	2022-2-16	1-6个月(含)	首发流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-4-1	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	2022-3-14	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	2022-6-30	1个月内(含)	首发流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301139	元道通信	2022-6-30	1-6个月(含)	首发流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301148	嘉戎技术	2022-4-14	1-6个月(含)	首发流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301150	中一科技	2022-4-14	1-6个月(含)	首发流通受限	163.56	82.76	120	19,627.20	9,931.20	-
301150	中一科技	2022-6-10	1-6个月(含)	送股流通受限	-	82.76	60	-	4,965.60	-
301151	冠龙节能	2022-3-30	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	2022-5-10	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	2022-1-7	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	2022-5-25	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	2022-4-11	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	2022-6-30	1个月内(含)	首发流通受限	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301175	中科环保	2022-6-30	1-6个月(含)	首发流通受限	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-



301181	标榜股份	2022-2-11	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	2022-4-13	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	2022-1-4	1-6 个月(含)	首发流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022-2-18	1-6 个月(含)	首发流通受限	76.56	51.92	543	41,572.08	28,192.56	-
301201	诚达药业	2022-1-12	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	2022-4-7	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	2022-2-28	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	2022-3-21	1-6 个月(含)	首发流通受限	35.68	29.84	700	24,976.00	20,888.00	-
301217	铜冠铜箔	2022-1-20	1-6 个月(含)	首发流通受限	17.27	14.83	2,359	40,739.93	34,983.97	-
301219	腾远钴业	2022-3-10	1-6 个月(含)	首发流通受限	173.98	87.82	116	20,181.68	10,187.12	-
301219	腾远钴业	2022-5-24	1-6 个月(含)	送股流通受限	-	87.82	93	-	8,167.26	-
301220	亚香股份	2022-6-15	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	2022-3-2	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	2022-1-21	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	2022-6-24	1 个月内(含)	首发流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022-6-24	1-6 个月(含)	首发流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301235	华康医疗	2022-1-21	1-6 个月(含)	首发流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301236	软通动力	2022-3-8	1-6 个月(含)	首发流通受限	72.88	31.38	567	41,322.96	17,792.46	-
301236	软通动力	2022-6-9	1-6 个月(含)	送股流通受限	-	31.38	284	-	8,911.92	-
301237	和顺科技	2022-3-16	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	2022-6-10	1-6 个月(含)	首发流通受限	19.18	32.07	2,051	39,338.18	65,775.57	-
301239	普瑞眼科	2022-6-22	1 个月内(含)	首发流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022-6-22	1-6 个月(含)	首发流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301248	杰创智能	2022-4-13	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	2022-3-14	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	2022-3-21	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	2022-4-18	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	2022-3-22	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	2022-3-29	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	2022-4-6	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	2022-6-6	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	2022-4-14	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	2022-5-27	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	2022-6-16	1-6 个月(含)	首发流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
688150	莱特光电	2022-3-10	1-6 个月(含)	首发流通受限	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60	-
688237	超卓航科	2022-6-24	1 个月内(含)	首发流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688281	华秦科技	2022-2-28	1-6 个月(含)	首发流通受限	189.50	246.22	2,050	388,475.00	504,751.00	-
688281	华秦科技	2022-6-6	1-6 个月(含)	送股流通受限	-	246.22	820	-	201,900.40	-
688322	奥比中光	2022-6-30	1 个月内(含)	首发流通受限	30.99	30.99	4,264	132,141.36	132,141.36	-
688400	凌云光	2022-6-27	1 个月内(含)	首发流通受限	21.93	21.93	12,433	272,655.69	272,655.69	-

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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金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工商银行；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，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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(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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 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净资产的 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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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净资产的 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净资产的 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、债券投资和买入返售金融资产等。

#### 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	84,579,647.67	-	-	-	84,579,647.67
结算备付金	1,518,841.74	-	-	-	1,518,841.74
存出保证金	346,935.28	-	-	-	346,935.28
交易性金融资产	-	-	-	-690,884,203.40	690,884,203.40
应收申购款	-	-	-	3,513.54	3,513.54
资产总计	86,445,424.69	-	-	-690,887,716.94	777,333,141.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	90,550.39	90,550.39
应付管理人报酬	-	-	-	885,227.92	885,227.92
应付托管费	-	-	-	147,537.99	147,537.99
应付清算款	-	-	-	9,849,237.06	9,849,237.06
其他负债	-	-	-	1,500,574.05	1,500,574.05
负债总计	-	-	-	12,473,127.41	12,473,127.41
利率敏感度缺口	86,445,424.69	-	-	-678,414,589.53	764,860,014.22
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	122,402,266.01	-	-	-	122,402,266.01
结算备付金	4,363,049.91	-	-	-	4,363,049.91
存出保证金	334,665.91	-	-	-	334,665.91
交易性金融资产	-	-	-	-734,172,269.09	734,172,269.09
应收申购款	-	-	-	6,091.56	6,091.56
其他资产	-	-	-	12,941.65	12,941.65
资产总计	127,099,981.83	-	-	-734,191,302.30	861,291,284.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	384,538.20	384,538.20
应付管理人报酬	-	-	-	1,073,029.27	1,073,029.27
应付托管费	-	-	-	178,838.22	178,838.22
应付证券清算款	-	-	-	20,063,778.41	20,063,778.41
其他负债	-	-	-	2,529,258.07	2,529,258.07
负债总计	-	-	-	24,229,442.17	24,229,442.17

利率敏感度缺口	127,099,981.83	-	-709,961,860.13	837,061,841.96
---------	----------------	---	-----------------	----------------

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，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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，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投资(含存托凭证)比例为基金总资产的 60%-95%，债券为 0%-40%，并保持不低于基金净资产 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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 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	690,884,203.40	90.33	734,172,269.09	87.71

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	690,884,203.40	90.33	734,172,269.09	87.71

#### 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 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数收益率上升 5%	28,819,430.69	35,417,747.30
	沪深 300 指数收益率下降 5%	-28,819,430.69	-35,417,747.30

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	687,975,024.03	732,069,131.52
第二层次	1,243,579.23	380,229.35
第三层次	1,665,600.14	1,722,908.22
合计	690,884,203.40	734,172,269.09

###### 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	690,884,203.40	88.88
	其中：股票	690,884,203.40	88.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	86,098,489.41	11.08
8	其他各项资产	350,448.82	0.05
9	合计	777,333,141.63	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	51,148,359.20	6.69
B	采矿业	-	-

C	制造业	444,082,973.09	58.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,652,205.00	0.74
F	批发和零售业	53,294,909.34	6.97
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	7,640,148.78	1.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,590,666.10	2.69
J	金融业	46,342,740.60	6.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	39,579,882.84	5.17
M	科学研究和技术服务业	75,237.33	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	13,377,660.61	1.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,099,420.51	1.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	690,884,203.40	90.33

### 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	600519	贵州茅台	23,300	47,648,500.00	6.23
2	000858	五粮液	157,400	31,783,782.00	4.16
3	601933	永辉超市	7,200,000	30,816,000.00	4.03
4	002832	比音勒芬	1,153,483	29,067,771.60	3.80
5	601888	中国中免	120,200	27,998,186.00	3.66
6	002032	苏泊尔	473,900	26,699,526.00	3.49
7	603345	安井食品	147,900	24,827,973.00	3.25
8	002959	小熊电器	396,570	24,718,208.10	3.23
9	603198	迎驾贡酒	352,500	22,961,850.00	3.00
10	603833	欧派家居	150,100	22,617,068.00	2.96
11	002714	牧原股份	345,344	19,087,162.88	2.50
12	600612	老凤祥	418,200	17,472,396.00	2.28
13	603369	今世缘	336,400	17,156,400.00	2.24
14	000568	泸州老窖	64,500	15,901,830.00	2.08
15	600030	中信证券	723,010	15,660,396.60	2.05
16	600809	山西汾酒	47,500	15,428,000.00	2.02
17	300498	温氏股份	724,400	15,422,476.00	2.02

18	002727	一心堂	665,000	15,248,450.00	1.99
19	002557	洽洽食品	264,700	15,069,371.00	1.97
20	300896	爱美客	24,900	14,940,249.00	1.95
21	600600	青岛啤酒	136,900	14,226,648.00	1.86
22	300911	亿田智能	184,057	14,144,780.45	1.85
23	603477	巨星农牧	553,400	13,270,532.00	1.74
24	603136	天目湖	456,000	13,068,960.00	1.71
25	300999	金龙鱼	240,400	12,986,408.00	1.70
26	688232	新点软件	327,523	12,321,415.26	1.61
27	600919	江苏银行	1,629,500	11,602,040.00	1.52
28	600138	中青旅	896,954	11,561,737.06	1.51
29	000001	平安银行	766,800	11,486,664.00	1.50
30	603868	飞科电器	143,600	10,877,700.00	1.42
31	002840	华统股份	591,620	10,442,093.00	1.37
32	002567	唐人神	1,094,600	9,315,046.00	1.22
33	300015	爱尔眼科	198,566	8,889,799.82	1.16
34	000799	酒鬼酒	44,000	8,175,640.00	1.07
35	000596	古井贡酒	32,400	8,088,984.00	1.06
36	002304	洋河股份	41,900	7,673,985.00	1.00
37	605108	同庆楼	323,598	7,640,148.78	1.00
38	601838	成都银行	458,000	7,593,640.00	0.99
39	603708	家家悦	502,900	7,161,296.00	0.94
40	300523	辰安科技	256,100	7,142,629.00	0.93
41	002594	比亚迪	21,000	7,003,290.00	0.92
42	603801	志邦家居	226,080	6,099,638.40	0.80
43	000065	北方国际	668,900	5,652,205.00	0.74
44	601012	隆基绿能	56,800	3,784,584.00	0.49
45	001201	东瑞股份	87,304	3,368,188.32	0.44
46	301238	瑞泰新材	20,509	760,350.11	0.10
47	688297	中无人机	14,079	748,721.22	0.10
48	688281	华秦科技	2,870	706,651.40	0.09
49	688349	三一重能	13,125	534,843.75	0.07
50	688052	纳芯微	1,392	527,512.32	0.07
51	688047	龙芯中科	4,079	375,879.85	0.05
52	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.04
53	688400	凌云光	12,433	272,655.69	0.04
54	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.03
55	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.03
56	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.03
57	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.03
58	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.02
59	688322	奥比中光	4,264	132,141.36	0.02

60	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.02
61	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
62	688150	莱特光电	5,626	110,269.60	0.01
63	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
64	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
65	301217	铜冠铜箔	2,359	34,983.97	0.00
66	301177	迪阿股份	443	32,870.60	0.00
67	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
68	301200	大族数控	543	28,192.56	0.00
69	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
70	301236	软通动力	851	26,704.38	0.00
71	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
72	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
73	301109	军信股份	1,379	22,257.06	0.00
74	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
75	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
76	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
77	301216	万凯新材	700	20,888.00	0.00
78	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
79	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
80	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
81	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
82	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
83	301219	腾远钴业	209	18,354.38	0.00
84	301221	光庭信息	280	18,152.40	0.00
85	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
86	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
87	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
88	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
89	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
90	300834	星辉环材	513	15,405.39	0.00
91	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
92	301150	中一科技	180	14,896.80	0.00
93	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
94	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
95	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
96	301189	奥尼电子	435	14,489.85	0.00
97	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
98	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
99	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
100	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
101	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00

102	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
103	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
104	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
105	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
106	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
107	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
108	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
109	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
110	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
111	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
112	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
113	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
114	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
115	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
116	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
117	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
118	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
119	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
120	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
121	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
122	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
123	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
124	002687	乔治白	95	424.65	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	000333	美的集团	67,187,682.00	8.03
2	601933	永辉超市	66,586,451.00	7.95
3	000858	五粮液	51,221,337.00	6.12
4	601888	中国中免	42,987,494.80	5.14
5	605108	同庆楼	41,341,329.50	4.94
6	002714	牧原股份	38,515,256.19	4.60
7	002475	立讯精密	37,751,759.00	4.51
8	603369	今世缘	33,003,873.03	3.94
9	600030	中信证券	31,413,209.00	3.75
10	600519	贵州茅台	31,162,833.00	3.72
11	601800	中国交建	29,053,497.42	3.47
12	300498	温氏股份	28,519,514.60	3.41
13	600809	山西汾酒	28,421,669.00	3.40
14	688232	新点软件	27,294,291.33	3.26

15	002032	苏泊尔	26,323,359.00	3.14
16	000887	中鼎股份	25,909,268.49	3.10
17	601166	兴业银行	24,399,260.00	2.91
18	002939	长城证券	23,965,936.00	2.86
19	601339	百隆东方	23,957,354.57	2.86
20	601658	邮储银行	23,112,277.48	2.76
21	603198	迎驾贡酒	21,675,156.37	2.59
22	002959	小熊电器	21,359,331.14	2.55
23	603801	志邦家居	20,653,321.60	2.47
24	603345	安井食品	19,732,993.00	2.36
25	600975	新五丰	19,631,671.00	2.35
26	600887	伊利股份	19,607,803.00	2.34
27	300911	亿田智能	19,016,203.00	2.27
28	600585	海螺水泥	18,970,983.36	2.27
29	603363	傲农生物	18,781,013.97	2.24
30	601088	中国神华	18,616,921.99	2.22
31	002557	洽洽食品	18,483,550.41	2.21
32	603136	天目湖	18,390,794.26	2.20
33	603833	欧派家居	18,269,536.09	2.18
34	002727	一心堂	17,782,351.00	2.12
35	600600	青岛啤酒	16,824,287.00	2.01

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	000333	美的集团	63,052,208.08	7.53
2	300033	同花顺	45,361,238.44	5.42
3	600887	伊利股份	44,271,863.60	5.29
4	601339	百隆东方	43,402,158.72	5.19
5	605108	同庆楼	35,715,784.00	4.27
6	002475	立讯精密	34,879,790.00	4.17
7	600690	海尔智家	33,988,814.00	4.06
8	600138	中青旅	32,984,442.47	3.94
9	600519	贵州茅台	32,839,362.78	3.92
10	002154	报喜鸟	32,584,589.44	3.89
11	601933	永辉超市	32,300,708.30	3.86
12	002831	裕同科技	30,985,049.00	3.70
13	601800	中国交建	28,573,456.00	3.41
14	600882	妙可蓝多	27,980,061.00	3.34
15	600585	海螺水泥	27,106,643.00	3.24
16	600975	新五丰	26,051,345.78	3.11

17	601166	兴业银行	25,658,016.00	3.07
18	601658	邮储银行	23,300,175.00	2.78
19	002832	比音勒芬	21,591,213.16	2.58
20	002939	长城证券	21,348,023.00	2.55
21	603363	傲农生物	20,146,732.99	2.41
22	000858	五粮液	20,023,774.39	2.39
23	603198	迎驾贡酒	19,638,425.43	2.35
24	601088	中国神华	19,373,024.00	2.31
25	000799	酒鬼酒	19,304,241.30	2.31
26	601952	苏垦农发	19,049,078.80	2.28
27	002714	牧原股份	18,500,970.20	2.21
28	600919	江苏银行	18,371,293.40	2.19
29	603290	斯达半导	18,218,872.00	2.18
30	002572	索菲亚	17,965,215.00	2.15
31	002179	中航光电	17,831,868.40	2.13
32	603136	天目湖	17,265,925.60	2.06
33	000887	中鼎股份	17,056,277.82	2.04
34	688155	先惠技术	17,037,564.51	2.04
35	600031	三一重工	16,879,950.00	2.02

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	1,829,794,016.81
卖出股票收入（成交）总额	1,818,095,501.76

注：“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，相关交易费用不考虑。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

**7.10 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 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	346,935.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,513.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	350,448.82

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------



(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
19,111	20,521.76	87,877,525.04	22.41	304,313,762.82	77.59

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	14,440.89	0.00368

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2006 年 11 月 15 日) 基金份额总额	3,364,280,448.23
本报告期期初基金份额总额	398,853,953.58
本报告期基金总申购份额	1,928,849.06
减：本报告期基金总赎回份额	8,591,514.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	392,191,287.86

## § 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重大人事变动

本报告期，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 (%)	
光大证券	1	894,748,245.63	24.66	819,753.86	24.73	-
东北证券	1	631,428,867.03	17.40	576,930.96	17.41	-
招商证券	1	559,806,200.91	15.43	510,153.68	15.39	-
中信建投	1	530,941,804.03	14.63	483,825.24	14.60	-
开源证券	1	278,166,708.78	7.67	255,494.94	7.71	-
中信证券	3	229,935,022.07	6.34	209,535.98	6.32	-
首创证券	1	197,928,150.02	5.45	180,371.03	5.44	-
西部证券	3	176,349,724.25	4.86	160,714.56	4.85	-
华西证券	3	67,441,997.94	1.86	61,459.76	1.85	-
东兴证券	1	50,720,411.17	1.40	46,218.30	1.39	-
安信证券	1	11,127,007.00	0.31	10,250.54	0.31	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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) 资力雄厚，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，新增中信证券 1 个交易单元；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 (%)
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

华西证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通关于旗下部分开放式基金参加宁波银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-1-25
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	2022-2-21
3	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	2022-4-6
4	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	2022-4-13
5	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	2022-5-30
6	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	2022-6-10

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

机构	1	20220101-20220630	84,371,237.45	-	-	84,371,237.45	21.51
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

## 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）《融通动力先锋混合型证券投资基金基金合同》
- （二）《融通动力先锋混合型证券投资基金托管协议》
- （三）《融通动力先锋混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- （四）中国证监会批准融通动力先锋股票型证券投资基金设立的文件
- （五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- （六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2022 年 8 月 26 日