融通品质优选混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通品质优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同约定，于 2026 年 8 月 13 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 6
3.3 其他指标 8

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 11

§5 托管人报告 11

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 14
6.4 报表附注 16

§7 投资组合报告 36

7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 36
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 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40

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 40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41
7.12 投资组合报告附注 41
§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 盈利投资者数量占比 42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 42
§9 开放式基金份额变动 43
§10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 44
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 44
10.8 其他重大事件 46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 47
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 47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 47
§12 备查文件目录 47
12.1 备查文件目录 47
12.2 存放地点 47
12.3 查阅方式 47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通品质优选混合型证券投资基金	
基金简称	融通品质优选混合	
基金主代码	021899	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 2 月 25 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,040,368.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通品质优选混合 A	融通品质优选混合 C
下属分级基金的交易代码	021899	021900
报告期末下属分级基金的份额总额	8,632,244.21 份	3,408,123.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对行业进行深入研究分析，精选品质卓越的上市企业进行中长期投资，在合理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增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等部分。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%+中证港股通综合指数收益率×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，低于股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方毅祖	任航
	联系电话	（0755）26948666	010-66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-883-8088、（0755）26948088	95599
传真		（0755）26935005	010-68121816
注册地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518054	100031
法定代表人		张威	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区粤海街道海珠社区海德三道 1066 号深创投广场 41 层、42 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	融通品质优选混合 A	融通品质优选混合 C
本期已实现收益	-1,008,984.19	-318,337.17
本期利润	-713,542.77	-155,156.76
加权平均基金份额本期利润	-0.0654	-0.0459
本期加权平均净值利润率	-7.41%	-5.27%
本期基金份额净值增长率	-5.62%	-5.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-866,749.23	-363,163.90
期末可供分配基金份额利润	-0.1004	-0.1066
期末基金资产净值	7,765,494.98	3,044,959.97
期末基金份额净值	0.8996	0.8934
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-10.04%	-10.66%

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

融通品质优选混合 A

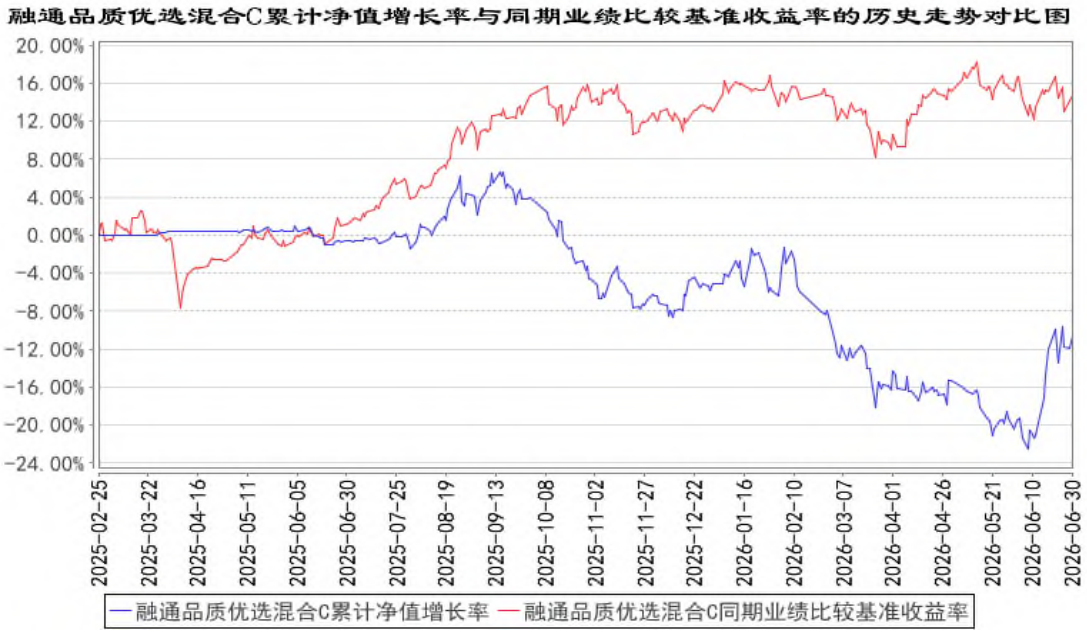
阶段	份额净值	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①－③	②－④

	增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	6.83%	1.55%	5.25%	0.91%	1.58%	0.64%
过去六个月	-5.62%	1.47%	1.59%	0.86%	-7.21%	0.61%
过去一年	-9.68%	1.16%	13.52%	0.77%	-23.20%	0.39%
自基金合同生效起至今	-10.04%	1.01%	14.77%	0.83%	-24.81%	0.18%

融通品质优选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.69%	1.55%	5.25%	0.91%	1.44%	0.64%
过去六个月	-5.87%	1.47%	1.59%	0.86%	-7.46%	0.61%
过去一年	-10.14%	1.16%	13.52%	0.77%	-23.66%	0.39%
自基金合同生效起至今	-10.66%	1.01%	14.77%	0.83%	-25.43%	0.18%

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



注：本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，至建仓期结束，各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
关山	本基金的基金经理	2025 年 2 月 25 日	-	20 年	关山女士，金融学硕士，20 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。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、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长证券投资基金基金经理、融通消费升级混合型证券投资基金基金经理，现任融通新消费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、融通品质优选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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年的行情主要集中在 2 季度，创业板科创板带来市场对于科技信仰的进一步增强。4 月份开始市场对外围风险的逐步免疫，美伊战争及油价的高位波动，联储政策走向等均不再被主要定价。强劲的 AI 趋势，海内外的不断共振，包括硬件类投资，相关产业链的环节紧缺涨价等等被市场充分交易。AI 相关的应用确实越来越多的在我们日常工作及生活中被体验，同时带来了便利和效率的提升，市场也越来越认可这是一个明确的科技趋势，也在从不断的质疑中一步步走过来。而与之相对应的是，对于经济的影响目前可能是非常不均匀的，有些人及产业受益明显，而有些则要面对受损的担忧。在 2 季度受行业标杆企业上市的预期，国产半导体设备板块走出非常突出的行情，作为大科技链条的一个分支，给与了市场极大的热情和民族自豪感，半导体指数在 6 月份进一步拉大了科技和非科技行业收益率的差距。

我们组合在 2 季度做了比较多调仓，主要是在消费板块内部做了比较多调仓，增加了科技相关的消费和一些传统消费类公司开启科技相关第二主业的标的。春节过后，整体消费板块承压，我们在 1 季度配置的很多服务类消费出行链标的，在春节后受油价影响担心放大。尤其在五一过后，随着整体消费数据的疲弱及对未来的担心，整个板块出现典型的杀估值过程。而科技相关板块很多细分环节出现了持续的通胀线索，市场对于产品结构变化及涨价预期极为敏感，同时叠加海外映射，市场走势极端分化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通品质优选混合 A 基金份额净值为 0.8996 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.62%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%；

截至本报告期末融通品质优选混合 C 基金份额净值为 0.8934 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.87%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月份开始，海内外科技出现大幅回调，市场配置均衡化及价值股阶段性有所表现。对于后续市场展望，我们倾向于认为这次行情的科技底色并没有改变，但是行业及标的的缩圈已形成共识。虽然现在市场对于投资的强度和现金流情况的不匹配总是被提及，但是我们看到头部模型厂商仍在不断的你追我赶，同时 AI 的运用场景仍在不断的拓宽。对于国内经济的情况市场也较为关注，虽然 2025 年下半年消费的增长基数也有所走低，但是目前观测的数据仍然较弱，高端消费明显好于普通类消费，K 型分化态势较为明显。还有出口链的一些优质公司，因为汇率关税及航运的扰动，在短期利润层面出现波动，但是这些公司的底层逻辑仍然存在，我们也持续关注。当前

进入到中报业绩期，很多前期市场拥抱的逻辑将逐步要开始验证，我们也将积极甄别相关个股的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日，基金管理人自主承担本基金项下相关固定费用。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复

核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通品质优选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,499,696.56	2,404,318.27
结算备付金		334,244.65	132,060.89
存出保证金		11,415.24	39,881.30
交易性金融资产	6.4.7.2	9,047,743.78	14,649,209.70
其中：股票投资		9,047,743.78	14,649,209.70
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		280,436.96	321,126.24
应收股利		10,263.85	11,364.15
应收申购款		69,722.01	239.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		11,253,523.05	17,558,200.54
负债和净资产	**附注号**	**本期末**	**上年度末**

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		398,075.21	340,421.26
应付赎回款		16,911.08	473.02
应付管理人报酬		10,478.29	17,228.10
应付托管费		1,746.40	2,871.35
应付销售服务费		1,207.71	1,357.61
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	14,649.41	135,412.19
负债合计		443,068.10	497,763.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	12,040,368.08	17,912,428.88
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-1,229,913.13	-851,991.87
净资产合计		10,810,454.95	17,060,437.01
负债和净资产总计		11,253,523.05	17,558,200.54

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，融通品质优选混合 A 类基金份额净值 0.8996 元，基金份额总额 8,632,244.21 份；融通品质优选混合 C 类基金份额净值 0.8934 元，基金份额总额 3,408,123.87 份；总份额合计 12,040,368.08 份。

6.2 利润表

会计主体：融通品质优选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-771,397.29	1,714,316.10
1.利息收入		4,690.77	729,744.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,690.77	359,058.82
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	370,686.09

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,245,337.92	22,009.60
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,291,343.05	-332,942.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	137,276.76
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	46,005.13	217,675.00
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	458,621.83	-290,298.14
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	10,628.03	1,252,859.73
减：二、营业总支出		97,302.24	1,283,832.63
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	75,241.33	950,428.86
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	12,540.20	158,404.84
3．销售服务费	6.4.10.2.3	7,306.59	108,403.41
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.23	2,214.12	66,595.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-868,699.53	430,483.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-868,699.53	430,483.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-868,699.53	430,483.47

6.3 净资产变动表

会计主体：融通品质优选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	17,912,428.88	-	-851,991.87	17,060,437.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	17,912,428.88	-	-851,991.87	17,060,437.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,872,060.80	-	-377,921.26	-6,249,982.06
（一）、综合收益总额	-	-	-868,699.53	-868,699.53
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-5,872,060.80	-	490,778.27	-5,381,282.53
其中：1.基金申购款	2,336,926.43	-	-316,117.64	2,020,808.79
2.基金赎回款	-8,208,987.23	-	806,895.91	-7,402,091.32
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	12,040,368.08	-	-1,229,913.13	10,810,454.95

项目	上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	611,510,898.66	-	-	611,510,898.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-530,896,405.31	-	-344,199.32	-531,240,604.63
（一）、综合收益总额	-	-	430,483.47	430,483.47
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-530,896,405.31	-	-774,682.79	-531,671,088.10
其中：1.基金申购款	723,499.07	-	2,277.09	725,776.16

2.基金赎回款	-531,619,904.38	-	-776,959.88	-532,396,864.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	80,614,493.35	-	-344,199.32	80,270,294.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

商小虎	高翔	郑刚
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

融通品质优选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[2024]959 号文《关于准予融通品质优选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，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《融通品质优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集，募集期为 2024 年 12 月 19 日至 2025 年 2 月 21 日。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 611,322,994.38 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70072774_H03 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通品质优选混合型证券投资基金基金合同》于 2025 年 2 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 611,510,898.66 份基金份额，其中认购资金利息折合 187,904.28 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《融通品质优选混合型证券投资基金基金合同》和《融通品质优选混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购费/申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；不收取认购费和申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通品质优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股

票（含创业板以及其他依法发行上市的股票、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（简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%+中证港股通综合指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

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

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

（2）企业所得税

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

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

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策

的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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

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

（4）印花税

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

（5）境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,499,696.56
等于：本金	1,499,538.13
加：应计利息	158.43
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	1,499,696.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,020,361.42	-	9,047,743.78	1,027,382.36
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		8,020,361.42	-	9,047,743.78	1,027,382.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,645.86
其中：交易所市场	14,645.86
银行间市场	-
应付利息	-
合计	14,649.41

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通品质优选混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,558,831.10	14,558,831.10
本期申购	334,050.92	334,050.92
本期赎回（以“-”号填列）	-6,260,637.81	-6,260,637.81
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	8,632,244.21	8,632,244.21

融通品质优选混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,353,597.78	3,353,597.78
本期申购	2,002,875.51	2,002,875.51
本期赎回（以“-”号填列）	-1,948,349.42	-1,948,349.42
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	3,408,123.87	3,408,123.87

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

融通品质优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	590,372.54	-1,271,534.96	-681,162.42
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	590,372.54	-1,271,534.96	-681,162.42
本期利润	-1,008,984.19	295,441.42	-713,542.77
本期基金份额交易产生的变动数	43,739.88	484,216.08	527,955.96
其中：基金申购款	-4,059.48	-39,832.55	-43,892.03
基金赎回款	47,799.36	524,048.63	571,847.99
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-374,871.77	-491,877.46	-866,749.23

融通品质优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	121,132.62	-291,962.07	-170,829.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	121,132.62	-291,962.07	-170,829.45
本期利润	-318,337.17	163,180.41	-155,156.76
本期基金份额交易产生的变动数	28,222.44	-65,400.13	-37,177.69
其中：基金申购款	-45,422.57	-226,803.04	-272,225.61
基金赎回款	73,645.01	161,402.91	235,047.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-168,982.11	-194,181.79	-363,163.90

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,080.44
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	568.53
其他	41.80
合计	4,690.77

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,291,343.05
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	-1,291,343.05

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	34,905,100.87

减：卖出股票成本总额	36,139,848.88
减：交易费用	56,595.04
买卖股票差价收入	-1,291,343.05

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	46,005.13
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	46,005.13

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	458,621.83
股票投资	458,621.83
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	458,621.83

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,628.27
基金转换费收入	999.76
合计	10,628.03

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	2,214.12
合计	2,214.12

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司(“融通基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
诚通证券股份有限公司(“诚通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	75,241.33	950,428.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	35,959.69	455,367.36
应支付基金管理人的净管理费	39,281.64	495,061.50

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

H=E×1.20%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,540.20	158,404.84

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

H=E×0.20%/当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通品质优选混合 A	融通品质优选混合 C	合计
融通基金	-	7.99	7.99
中国农业银行	-	4,502.13	4,502.13
诚通证券	-	2,231.82	2,231.82
合计	-	6,741.94	6,741.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通品质优选混合 A	融通品质优选混合 C	合计
融通基金	-	0.87	0.87
中国农业银行	-	86,577.17	86,577.17
诚通证券	-	20,404.63	20,404.63
合计	-	106,982.67	106,982.67

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。计算方法如下：

H=E×0.50%/当年天数

H 为每日 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年2月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	1,499,696.56	4,080.44	68,604,828.98	146,414.51

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，可能会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的

风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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

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

在公司管理层下设立合规与风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及的各类重大风险，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；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无债券投资（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算

备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,499,696.56	-	-	-	1,499,696.56
结算备付金	334,244.65	-	-	-	334,244.65
存出保证金	11,415.24	-	-	-	11,415.24
交易性金融资产	-	-	-	9,047,743.78	9,047,743.78
应收股利	-	-	-	10,263.85	10,263.85
应收申购款	-	-	-	69,722.01	69,722.01
应收清算款	-	-	-	280,436.96	280,436.96
资产总计	1,845,356.45	-	-	9,408,166.60	11,253,523.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,911.08	16,911.08
应付管理人报酬	-	-	-	10,478.29	10,478.29
应付托管费	-	-	-	1,746.40	1,746.40
应付清算款	-	-	-	398,075.21	398,075.21
应付销售服务费	-	-	-	1,207.71	1,207.71
其他负债	-	-	-	14,649.41	14,649.41
负债总计	-	-	-	443,068.10	443,068.10
利率敏感度缺口	1,845,356.45	-	-	8,965,098.50	10,810,454.95
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,404,318.27	-	-	-	2,404,318.27
结算备付金	132,060.89	-	-	-	132,060.89
存出保证金	39,881.30	-	-	-	39,881.30
交易性金融资产	-	-	-	14,649,209.70	14,649,209.70
应收股利	-	-	-	11,364.15	11,364.15
应收申购款	-	-	-	239.99	239.99
应收清算款	-	-	-	321,126.24	321,126.24
资产总计	2,576,260.46	-	-	14,981,940.08	17,558,200.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	473.02	473.02
应付管理人报酬	-	-	-	17,228.10	17,228.10
应付托管费	-	-	-	2,871.35	2,871.35
应付清算款	-	-	-	340,421.26	340,421.26
应付销售服务费	-	-	-	1,357.61	1,357.61
其他负债	-	-	-	135,412.19	135,412.19
负债总计	-	-	-	497,763.53	497,763.53
利率敏感度缺口	2,576,260.46	-	-	14,484,176.55	17,060,437.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2025 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	954,949.02	-	954,949.02
资产合计	-	954,949.02	-	954,949.02
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	954,949.02	-	954,949.02
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,128,505.70	-	3,128,505.70
资产合计	-	3,128,505.70	-	3,128,505.70
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,128,505.70	-	3,128,505.70

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月	上年度末 （2025 年 12 月

		30 日）	31 日 ）
	1.所有外币相对人民币升值 5%	47,747.45	156,425.29
	2.所有外币相对人民币贬值 5%	-47,747.45	-156,425.29

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。本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	9,047,743.78	83.69	14,649,209.70	85.87
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	9,047,743.78	83.69	14,649,209.70	85.87

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.沪深 300 指数收益率上升 5%	459,098.12	-
	2.沪深 300 指数收益率下降 5%	-459,098.12	-

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金合同生效尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	9,047,743.78	14,649,209.70
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	9,047,743.78	14,649,209.70

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对

公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,047,743.78	80.40
	其中：股票	9,047,743.78	80.40
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	1,833,941.21	16.30
8	其他各项资产	371,838.06	3.30
9	合计	11,253,523.05	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 954,949.02 元，占基金资产净值比例为 8.83%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	6,249,887.76	57.81
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	421,898.00	3.90
G	交通运输、仓储和邮政业	209,627.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	99,480.00	0.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	510,491.00	4.72
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	417,032.00	3.86
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	184,379.00	1.71
S	综合	-	-
	合计	8,092,794.76	74.86

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	-	-
能源	-	-
材料	555,068.60	5.13
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
科技	399,880.42	3.70
通讯	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	954,949.02	8.83

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600176	中国巨石	9,800	714,224.00	6.61
2	002832	比音勒芬	26,600	549,024.00	5.08
3	00148	建滔集团	5,000	512,010.23	4.74

4	603259	药明康德	4,100	510,491.00	4.72
5	000725	京东方 A	58,600	508,648.00	4.71
6	002916	深南电路	1,000	457,900.00	4.24
7	300857	协创数据	1,300	441,870.00	4.09
8	605098	行动教育	7,700	417,032.00	3.86
9	301345	涛涛车业	1,800	415,800.00	3.85
10	00992	联想集团	20,000	399,880.42	3.70
11	300308	中际旭创	300	381,000.00	3.52
12	300502	新易盛	600	364,200.00	3.37
13	603345	安井食品	4,100	328,779.00	3.04
14	000657	中钨高新	3,400	325,448.00	3.01
15	600549	厦门钨业	3,700	315,240.00	2.92
16	300866	安克创新	2,700	282,150.00	2.61
17	002371	北方华创	300	265,368.00	2.45
18	000026	飞亚达	10,400	224,016.00	2.07
19	002636	金安国纪	1,800	215,946.00	2.00
20	600676	交运股份	32,300	209,627.00	1.94
21	002780	三夫户外	16,300	197,882.00	1.83
22	688981	中芯国际	1,218	193,442.76	1.79
23	002858	力盛体育	16,900	184,379.00	1.71
24	688347	华虹宏力	510	171,513.00	1.59
25	300408	三环集团	900	150,210.00	1.39
26	002444	巨星科技	3,300	102,630.00	0.95
27	301396	宏景科技	300	99,480.00	0.92
28	601636	旗滨集团	6,500	66,495.00	0.62
29	01888	建滔积层板	500	43,058.37	0.40

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	600054	黄山旅游	975,656.00	5.72
2	002627	三峡旅游	914,529.00	5.36
3	300502	新易盛	855,517.00	5.01
4	002027	分众传媒	853,467.00	5.00
5	300308	中际旭创	754,564.00	4.42
6	002159	三特索道	693,235.00	4.06
7	002928	华夏航空	658,426.00	3.86
8	300866	安克创新	646,627.00	3.79
9	603288	海天味业	611,231.00	3.58
10	000333	美的集团	608,098.00	3.56
11	002475	立讯精密	579,309.00	3.40
12	601888	中国中免	566,978.00	3.32
13	002832	比音勒芬	562,069.00	3.29

14	300144	宋城演艺	555,611.00	3.26
15	002858	力盛体育	555,292.00	3.25
16	00700	腾讯控股	536,779.18	3.15
17	605098	行动教育	534,287.00	3.13
18	605108	同庆楼	515,211.00	3.02
19	603259	药明康德	500,805.00	2.94
20	300785	值得买	499,907.00	2.93
21	002916	深南电路	494,182.00	2.90
22	300857	协创数据	481,447.00	2.82
23	002555	三七互娱	478,579.00	2.81
24	09633	农夫山泉	473,655.05	2.78
25	00148	建滔集团	425,646.63	2.49
26	603402	陕西旅游	423,600.00	2.48
27	300792	壹网壹创	420,986.00	2.47
28	600258	首旅酒店	411,017.00	2.41
29	601021	春秋航空	409,176.00	2.40
30	301345	涛涛车业	408,347.00	2.39
31	603199	九华旅游	398,999.00	2.34
32	00992	联想集团	397,621.57	2.33
33	600176	中国巨石	396,801.00	2.33
34	002033	丽江股份	396,128.00	2.32
35	000725	京东方 A	374,862.00	2.20
36	002780	三夫户外	368,510.00	2.16
37	01318	毛戈平	354,314.54	2.08

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	601888	中国中免	1,265,012.00	7.41
2	600115	中国东航	841,818.00	4.93
2	00670	中国东方航空股份	367,414.03	2.15
3	600519	贵州茅台	1,140,138.00	6.68
4	002714	牧原股份	1,010,617.00	5.92
5	600054	黄山旅游	861,789.00	5.05
6	002558	巨人网络	848,222.00	4.97
7	002027	分众传媒	841,504.00	4.93
8	002956	西麦食品	838,791.40	4.92
9	300972	万辰集团	828,259.00	4.85
10	002627	三峡旅游	740,159.00	4.34
11	600754	锦江酒店	704,948.00	4.13
12	605499	东鹏饮料	693,368.00	4.06
13	300502	新易盛	683,392.00	4.01

14	002928	华夏航空	665,382.00	3.90
15	000333	美的集团	641,985.00	3.76
16	600298	安琪酵母	634,365.00	3.72
17	02517	锅圈	631,752.49	3.70
18	300308	中际旭创	609,964.00	3.58
19	002159	三特索道	594,231.00	3.48
20	300785	值得买	577,475.00	3.38
21	688300	联瑞新材	556,158.86	3.26
22	603288	海天味业	538,428.00	3.16
23	603345	安井食品	511,499.00	3.00
24	00700	腾讯控股	504,799.65	2.96
25	300144	宋城演艺	504,798.00	2.96
26	002475	立讯精密	503,462.00	2.95
27	01070	TCL 电子	502,154.01	2.94
28	601111	中国国航	380,613.00	2.23
28	00753	中国国航	120,143.21	0.70
29	605108	同庆楼	466,393.00	2.73
30	00667	中国东方教育	449,180.29	2.63
31	688256	寒武纪	436,201.06	2.56
32	300792	壹网壹创	424,499.00	2.49
33	002555	三七互娱	422,598.00	2.48
34	09633	农夫山泉	421,445.41	2.47
35	600029	南方航空	403,958.00	2.37
36	002384	东山精密	384,904.00	2.26
37	002033	丽江股份	356,792.00	2.09
38	603402	陕西旅游	352,250.00	2.06
39	02331	李宁	349,131.28	2.05
40	601021	春秋航空	347,891.00	2.04

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	30,079,761.13
卖出股票收入（成交）总额	34,905,100.87

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

无。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,415.24
2	应收清算款	280,436.96
3	应收股利	10,263.85

4	应收利息	-
5	应收申购款	69,722.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	371,838.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
融通品质优选混合 A	187	46,161.73	-	-	8,632,244.21	100.00
融通品质优选混合 C	249	13,687.24	-	-	3,408,123.87	100.00
合计	436	27,615.52	-	-	12,040,368.08	100.00

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	45.44

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通品质优选混合 A	0.99	0.00001
	融通品质优选混合 C	10,373.44	0.30437
	合计	10,374.43	0.08616

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通品质优选混合 A	0
	融通品质优选混合 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	融通品质优选混合 A	0
	融通品质优选混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通品质优选混合 A	融通品质优选混合 C
基金合同生效日（2025 年 2 月 25 日）基金份额总额	406,361,961.37	205,148,937.29
本报告期期初基金份额总额	14,558,831.10	3,353,597.78
本报告期基金总申购份额	334,050.92	2,002,875.51
减：本报告期基金总赎回份额	6,260,637.81	1,948,349.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,632,244.21	3,408,123.87

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

1、2026 年 4 月 20 日，本基金管理人发布了《关于以通讯方式召开融通品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，于 2026 年 4 月 24 日起至 2026 年 5 月 21 日 17：00 止期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于融通品质优选混合型证券投资基金持续运作的议案》。

2、2026 年 5 月 23 日，本基金管理人发布了《关于融通品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告》，根据计票结果，参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额未达到权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一），因此未达到《基金合同》约定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效条件。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
华创证券	2	15,086,388.40	23.22	6,576.47	23.13	-
华福证券	1	13,235,390.53	20.37	5,823.75	20.48	-
申万宏源	1	13,010,306.00	20.02	5,671.41	19.95	-
财通证券	1	12,661,095.21	19.48	5,564.46	19.57	-
广发证券	1	5,480,112.92	8.43	2,407.15	8.47	-
国泰海通证券	3	4,190,151.00	6.45	1,826.53	6.42	-
招商证券	1	1,102,340.00	1.70	480.51	1.69	-
中信证券	2	219,077.94	0.34	79.96	0.28	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国联民生证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

注：1.租用证券公司交易单元的标准为：

（1） 财务状况良好，最近一年经审计的净资产原则上不低于 20 亿元；

（2） 经营行为规范，最近一年内不存在可能影响证券研究服务和经纪业务稳定性的重大行政处罚或者刑事处罚；

（3） 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；

（4） 合规风控能力和交易等服务能力较强；

（5） 拥有良好的公司声誉；

（6） 交易、研究等服务能力较强，具有全面综合的研究服务能力，或在具体领域具有突出的特色研究服务，或能够提供较好的交易服务，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

（7） 券商分类监管评级原则上不得为 D 及以下。

2.租用证券公司交易单元的程序为：

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

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

3.交易单元变更情况

本报告期内交易单元无变更。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于取消监事暨监事离任公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 9 日
2	融通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
3	关于以通讯方式召开融通品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 20 日
4	关于以通讯方式召开融通品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 21 日
5	关于以通讯方式召开融通品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
6	2025 年度融通基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 30 日
7	关于融通品质优选混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 23 日
8	融通基金管理有限公司关于暂停中证金牛（北京）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 30 日
9	融通基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 5 日
10	融通基金关于旗下部分开放式基金参加中国人寿保险股份有限公司前端申购费率优惠活动及开通相关业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 15 日
11	融通基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予融通品质优选混合型证券投资基金募集注册的文件

（二）《融通品质优选混合型证券投资基金基金合同》

（三）《融通品质优选混合型证券投资基金托管协议》

（四）《融通品质优选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

（五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

（六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日