

融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 基金合同规定，于 2023 年 8 月 18 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 2023 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51

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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	融通领先成长混合 (LOF)	
基金主代码	161610	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2007 年 4 月 30 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	901,944,862.26 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2007 年 7 月 18 日	
下属分级基金的基金简称	融通领先成长混合 (LOF) A/B	融通领先成长混合 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	融通领先成长 LOF	-
下属分级基金的交易代码	161610	009241
下属分级基金的前端交易代码	161610	-
下属分级基金的后端交易代码	161660	-
报告期末下属分级基金的份额总额	897,579,166.32 份	4,365,695.94 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于符合中国经济发展方向, 依靠技术自主创新、领先的经营模式或优势的品牌、渠道等因素获得业绩持续高速增长, 从而推动中国经济结构提升的上市公司, 分享中国经济发展过程中结构性的高速增长; 通过积极主动的分散化投资策略, 在严格控制风险的前提下实现基金资产的持续增长, 为基金持有人获取长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金认为股价上升的主要推动力来自于企业盈利的不断增长。在中国经济长期高速增长的大背景下, 许多企业在一定时期表现出较高的成长性, 但只有符合产业结构发展趋势, 同时在技术创新、经营模式、品牌、渠道、成本等方面具有领先优势的企业, 才能保持业绩持续高速增长, 而这些企业正是本基金重点投资的目标和获得长期超额回报的基础。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 \times 80% + 中债综合全价 (总值) 指数收益率 \times 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与货币市场基金, 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	王小飞
	联系电话	(0755) 26948666	(021) 60637103

电子邮箱	service@mail.rtfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	(021) 60637228
传真	(0755) 26935005	(021) 60635778
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518053	100033
法定代表人	张威	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	融通领先成长混合 (LOF) A/B	融通领先成长混合 (LOF) C
本期已实现收益	-77,228,910.47	-246,315.85
本期利润	-49,053,627.59	-231,979.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0540	-0.0919
本期加权平均净值利润率	-3.60%	-6.27%
本期基金份额净值增长率	-3.65%	-3.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	705,554,234.43	638,995.38
期末可供分配基金份额利润	0.7861	0.1464
期末基金资产净值	1,301,562,292.92	6,234,395.30
期末基金份额净值	1.450	1.428
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	88.27%	11.48%

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

融通领先成长混合(LOF)A/B

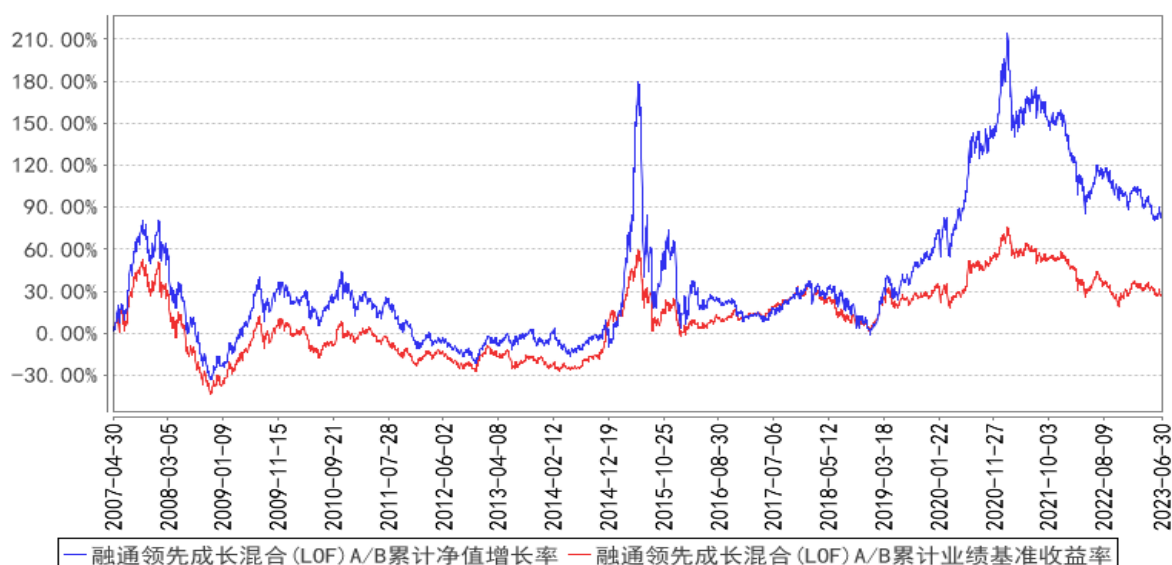
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.33%	0.96%	0.97%	0.70%	1.36%	0.26%
过去三个月	-3.01%	0.85%	-3.93%	0.66%	0.92%	0.19%
过去六个月	-3.65%	0.78%	-0.29%	0.67%	-3.36%	0.11%
过去一年	-14.76%	0.86%	-11.23%	0.79%	-3.53%	0.07%
过去三年	-9.15%	1.30%	-4.86%	0.96%	-4.29%	0.34%
自基金合同生效起至今	88.27%	1.68%	27.88%	1.32%	60.39%	0.36%

融通领先成长混合(LOF)C

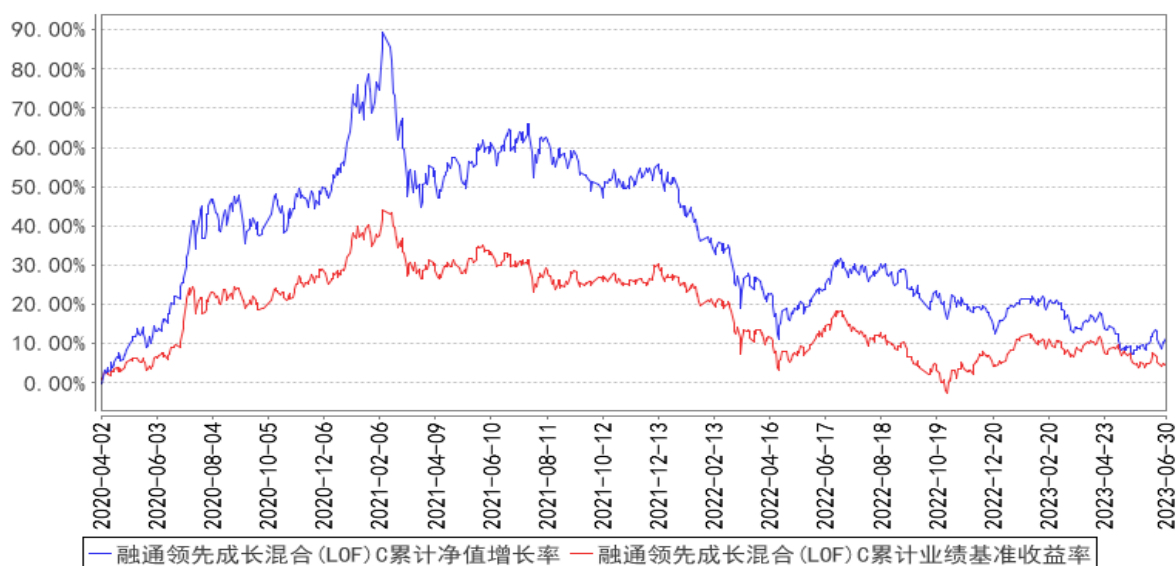
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.29%	0.96%	0.97%	0.70%	1.32%	0.26%
过去三个月	-3.12%	0.84%	-3.93%	0.66%	0.81%	0.18%
过去六个月	-3.84%	0.77%	-0.29%	0.67%	-3.55%	0.10%
过去一年	-15.15%	0.86%	-11.23%	0.79%	-3.92%	0.07%
过去三年	-10.53%	1.30%	-4.86%	0.96%	-5.67%	0.34%
自基金合同生效起至今	11.48%	1.29%	4.93%	0.94%	6.55%	0.35%

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

融通领先成长混合 (LOF) A/B 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通领先成长混合 (LOF) C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金业绩比较基准项目分段计算，其中 2015 年 9 月 30 日之前（含此日）采用“沪深 300 指数收益率×80%+中信标普全债指数收益率×20%。”，2015 年 10 月 1 日起使用新基准即“沪深 300 指数收益率×80%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%”。

2、本基金于 2020 年 4 月 1 日增加 C 类份额，该类份额首次确认日为 2020 年 4 月 2 日，故该类份额的统计期间为 2020 年 4 月 2 日至本报告期末。

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%。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、境内合格机构管理人资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境外机构投资者（RQFII）资格、合格境外机构投资者（QFII）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		
邹曦	本基金的基金经理、副总经理兼权益投资总监	2017年2月18日	-	22年	邹曦先生，中国人民银行研究生部金融学硕士，22年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2001年5月加入融通基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理、研究部总经理、权益投资部总经理、融通行业景气证券投资基金基金经理（2007年6月25日至2012年1月18日）、融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任公司副总经理兼权益投资总监、融通行业景气证券投资基金基金经理、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通产业趋势股票型证券投资基金基金经理、融通产业趋势精选混合型证券投资基金基金经理、融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
何龙	本基金的基金经理、组合投资部副总监	2018年8月23日	-	11年	何龙先生，武汉大学金融学硕士，11年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2012年7月加入融通基金管理有限公司，历任金融行业研究员、策略研究员、融通新蓝筹证券投资基金基金经理、融通研究优选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、融通核心趋势混合型证

					券投资基金基金经理、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通益混合型证券投资基金基金经理，现任组合投资部副总监、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 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、融通新蓝筹证券投资基金基金经理、融通价值趋势混合型证券投资基金基金经理、融通稳信增益 6 个月持有期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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

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

一季度最初的核心主线是疫后修复以及两会，因此我们将消费等复苏链的行业进行重点配置。两会后，复苏交易进入瓶颈期，贝塔弱化，增加结构性机会的配置。我们判断全年可能出现极致行情，类 2013 年，AI 是主线。因此我们在一季度后半段增加 TMT 配置，主要理由是与 2013 年相

比，一是宏观特征，均由前一年的复苏交易转至第二年相对平淡的复苏（2012 年底到 2013 年初），2023 年若无政策刺激的额外加力，大概率是弱复苏环境，二是股市流动性较弱，2013 年是宏观流动性紧导致的股市流动性弱，2023 年则是经历了基金牛市的洗礼（2019-2022 年），新增入市资金有限导致的流动性弱，这将导致市场难以出现普涨行情，反而是此消彼长的虹吸行情，三是产业趋势的萌芽，2013 年在 iPhone4 渗透率到一定程度后，手游等移动互联应用的爆发，2023 年则处在人工智能（大模型）经历前期积蓄力量后，在 ChatGPT 出现爆点，迎来新一轮的产业趋势。

二季度从宏观层面依然处于弱复苏阶段，市场对托底政策的预期逐步开始钝化，而关注点更多是聚焦于经济增速与增长质量的再平衡，市场依然呈现结构性机会。本基金继续基于投研一体化的公共组合策略，保持贝塔继续相对市场中性，将主要超额收益来源集中体现在分散的个股阿尔法层面，以保持组合的长期稳健性。我们基于产业趋势理论，考虑供需结构的再平衡等结构性因素，持续减仓了新能源和食品饮料等板块，并且维持一定低配比例。而从技术进步等角度，我们在通信，传媒，计算机，电子等行业加配了人工智能方向的个股，并且将通信和计算机的配置比例提升至超配。同时我们基于制度层面的边际变化和估值的相对优势，增加了一部分“国央企”个股的配置，主要集中在，建筑，化工，金融，公共事业等板块。最后，我们继续保持了对稳增长政策敏感性较高的地产方向的超配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通领先成长混合 (LOF) A/B 基金份额净值为 1.450 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.65%，同期业绩比较基准收益率为-0.29%；

截至本报告期末融通领先成长混合 (LOF) C 基金份额净值为 1.428 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.84%，同期业绩比较基准收益率为-0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断，下半年依然呈现弱复苏，宽流动性的宏观组合态势，政策定力稳定了我们长期的抗风险能力预期，股债性价比到了比较极值的区间，股票市场整体估值有望上修。传统行业的库存周期和新兴经济的产业趋势有望在下半年形成共振，股票市场已经进入了三年维度的较好配置区间。在宏观呈现弱复苏阶段，我们认为股票市场依然以结构性特征为主导，顺周期板块，新能源，TMT 等方向依然会反复胶着。而一旦宏观从弱复苏上修至强复苏，或者新兴产业，如人工智能等方向出现了新的变化，比如需求或者订单的超预期落地，那么市场有望从结构性特征切换至趋势性特征，市场的赚钱效应也会有明显改善。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则

和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2023年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	146,024,714.93	157,225,030.80
结算备付金		3,204,540.44	6,728,722.43
存出保证金		159,250.96	96,168.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,162,278,131.91	1,227,329,707.99
其中：股票投资		1,159,905,493.33	1,225,162,376.64
基金投资		-	-
债券投资		2,372,638.58	2,167,331.35
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	-	80,000,000.00
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		779,312.05	-
应收股利		-	-
应收申购款		530,135.05	86,090.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,312,976,085.34	1,471,465,719.45
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	80,000,000.00
应付赎回款		1,057,083.82	603,778.50
应付管理人报酬		1,599,521.56	1,784,351.59
应付托管费		266,586.94	297,391.93
应付销售服务费		1,898.85	1,458.46
应付投资顾问费		-	-
应交税费		65,660.90	65,661.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,188,645.05	2,030,255.69
负债合计		5,179,397.12	84,782,897.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	352,985,199.21	359,356,764.17
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	954,811,489.01	1,027,326,057.82
净资产合计		1,307,796,688.22	1,386,682,821.99
负债和净资产总计		1,312,976,085.34	1,471,465,719.45

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 901,944,862.26 份，其中融通领先成长混合 (LOF) A/B 类基金份额 897,579,166.32 份，基金份额净值 1.450 元；融通领先成长混合 (LOF) C 类基金份额 4,365,695.94 份，基金份额净值 1.428 元。

6.2 利润表

会计主体：融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		-37,278,895.31	-244,236,448.11
1. 利息收入		351,682.79	436,569.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	343,485.53	436,569.26
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		8,197.26	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-65,830,301.76	-121,967,027.75
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-77,056,648.07	-131,800,867.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,088.88	291,873.25
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	11,224,257.43	9,541,966.82
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	28,189,618.77	-122,732,693.95
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	10,104.89	26,704.33
减：二、营业总支出		12,006,712.24	13,867,511.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,172,421.59	11,760,099.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,695,403.64	1,960,016.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,198.56	7,263.81
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		7.65	4.20
8. 其他费用	6.4.7.23	129,680.80	140,127.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-49,285,607.55	-258,103,959.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-49,285,607.55	-258,103,959.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-49,285,607.55	-258,103,959.68

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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)	359,356,764.17	-	1,027,326,057.82	1,386,682,821.99
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)	359,356,764.17	-	1,027,326,057.82	1,386,682,821.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,371,564.96	-	-72,514,568.81	-78,886,133.77
(一)、综合收益总额	-	-	-49,285,607.55	-49,285,607.55
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-6,371,564.96	-	-23,228,961.26	-29,600,526.22
其中：1.基金申购款	21,930,667.49	-	19,619,420.96	41,550,088.45
2.基金赎回款	-28,302,232.45	-	-42,848,382.22	-71,150,614.67
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	352,985,199.21	-	954,811,489.01	1,307,796,688.22
项目	上年度可比期间 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)	375,672,724.16	-	1,523,686,972.16	1,899,359,696.32
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)	375,672,724.16	-	1,523,686,972.16	1,899,359,696.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,529,046.82	-	-292,374,589.23	-301,903,636.05

(一)、综合收益总额	-	-	-258,103,959.68	-258,103,959.68
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-9,529,046.82	-	-34,270,629.55	-43,799,676.37
其中：1. 基金申购款	15,936,465.69	-	26,043,111.14	41,979,576.83
2. 基金赎回款	-25,465,512.51	-	-60,313,740.69	-85,779,253.20
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	366,143,677.34	-	1,231,312,382.93	1,597,456,060.27

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

高翔

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

融通领先成长混合型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)由通宝证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)2007年4月17日证监基金字[2007]113号文核准的通宝证券投资基金持有人大会决议,通宝证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同,并更名为“融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)”。自2007年4月30日起,《融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据上述证监基金字[2007]113号文的核准,本基金自2007年5月11日至2007年5月25

日公开集中申购。经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2007)验字第 60468686_H01 号验资报告,于集中申购验资日(2007 年 5 月 30 日),集中申购收到的实收基金总计人民币 1,772,157,457.04 元,折合基金份额 1,772,157,457.04 份。集中申购验资结束日同时为原通宝证券投资基金的基金份额转换日。融通基金管理有限公司按照基金转换基准日(2007 年 5 月 30 日)原通宝证券投资基金的份额净值,对原通宝证券投资基金进行了基金份额转换。经基金托管人确认,原通宝证券投资基金的基金总份额由 500,000,000.00 份转换为 1,287,429,150.00 份。

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》,融通领先成长股票型证券投资基金(LOF)于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)。

根据本基金的基金管理人于 2020 年 3 月 30 日发布的《融通基金管理有限公司关于融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)增设 C 类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》,自 2020 年 4 月 1 日起对本基金进行份额分类,原有基金份额为 A/B 类份额,增设 C 类份额。在投资者申购时收取前端申购费用的份额,称为 A 类基金份额;在投资者赎回时收取后端申购费用的份额,称为 B 类基金份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额,称为 C 类基金份额。本基金分类后,本基金原有基金份额将自动划归为本基金 A/B 类基金份额。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的各类股票(含存托凭证)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票(含存托凭证)投资比例范围为基金资产的 60%-95%;权证投资比例范围为 0-3%;债券与货币市场工具的投资比例范围为 5%-40%,其中现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)和到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。本基金原业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 80%+中信标普全债指数收益率 \times 20%,根据本基金的基金管理人于 2015 年 11 月 11 日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》,自 2015 年 10 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%+中债综合全价(总值)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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 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本报告期末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等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%

的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	146,024,714.93
等于：本金	146,010,527.30
加：应计利息	14,187.63
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	146,024,714.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,156,837,464.25	-	1,159,905,493.33	3,068,029.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	1,757,388.10	2,908.76	2,372,638.58	612,341.72
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,757,388.10	2,908.76	2,372,638.58	612,341.72
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,158,594,852.35	2,908.76	1,162,278,131.91	3,680,370.80

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
	2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	52.10
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,820,197.01
其中：交易所市场	1,820,197.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	118,395.94
合计	2,188,645.05

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通领先成长混合 (LOF) A/B

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	919,385,949.11	357,089,316.94
本期申购	10,276,992.42	3,991,645.47
本期赎回 (以“-”号填列)	-32,083,775.21	-12,461,459.14
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	897,579,166.32	348,619,503.27

融通领先成长混合 (LOF) C

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,267,447.23	2,267,447.23
本期申购	17,939,022.02	17,939,022.02

本期赎回 (以“-”号填列)	-15,840,773.31	-15,840,773.31
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	4,365,695.94	4,365,695.94

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

融通领先成长混合 (LOF) A/B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	800,926,737.26	225,298,527.10	1,026,225,264.36
本期利润	-77,228,910.47	28,175,282.88	-49,053,627.59
本期基金份额交易产生的变动数	-18,143,592.36	-6,085,254.76	-24,228,847.12
其中：基金申购款	8,594,177.34	2,863,764.81	11,457,942.15
基金赎回款	-26,737,769.70	-8,949,019.57	-35,686,789.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	705,554,234.43	247,388,555.22	952,942,789.65

融通领先成长混合 (LOF) C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	530,517.45	570,276.01	1,100,793.46
本期利润	-246,315.85	14,335.89	-231,979.96
本期基金份额交易产生的变动数	354,793.78	645,092.08	999,885.86
其中：基金申购款	3,179,783.68	4,981,695.13	8,161,478.81
基金赎回款	-2,824,989.90	-4,336,603.05	-7,161,592.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	638,995.38	1,229,703.98	1,868,699.36

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	318,332.17
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	24,125.24
其他	1,028.12
合计	343,485.53

注：此处其他列示的是基金交易保证金利息收入。

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-77,056,648.07
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	-77,056,648.07

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,918,291,738.91
减：卖出股票成本总额	1,989,629,888.26
减：交易费用	5,718,498.72
买卖股票差价收入	-77,056,648.07

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,088.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,088.88

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	11,224,257.43
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	11, 224, 257. 43
----	------------------

6. 4. 7. 20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	28, 189, 618. 77
股票投资	27, 986, 463. 77
债券投资	203, 155. 00
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	28, 189, 618. 77

6. 4. 7. 21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9, 347. 71
基金转换费收入	757. 18
合计	10, 104. 89

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

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

6. 4. 7. 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49, 588. 57
信息披露费	59, 507. 37
证券出借违约金	-
银行费用	1, 984. 86
账户维护费	18, 600. 00
合计	129, 680. 80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
诚通证券	628,802,392.40	16.57	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)

诚通证券	579,302.37	16.57	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
诚通证券	-	-	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,172,421.59	11,760,099.11
其中：支付销售机构的客户维护费	4,590,152.34	5,290,003.79

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,695,403.64	1,960,016.50

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期

名称	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通领先成长混合 (LOF) A/B	融通领先成长混合 (LOF) C	合计
融通基金	-	158.28	158.28
合计	-	158.28	158.28
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通领先成长混合 (LOF) A/B	融通领先成长混合 (LOF) C	合计
融通基金	-	112.12	112.12
合计	-	112.12	112.12

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给融通基金，再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为。

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	146,024,714.93	318,332.17	287,964,261.31	414,710.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	1-6 个月(含)	首发流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023-03-31	1-6 个月(含)	首发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	1-6 个月(含)	首发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023-05-12	1-6 个月(含)	首发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	1-6 个月(含)	首发流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	1-6 个月(含)	首发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	1-6 个月(含)	首发流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	1-6 个月(含)	首发流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023-06-15	1-6 个月(含)	首发流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	1-6 个月(含)	首发流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-

301157	华塑科技	2023-03-01	1-6个月(含)	首发流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	1-6个月(含)	首发流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	首发流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1-6个月(含)	首发流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023-03-28	1-6个月(含)	首发流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023-06-21	1-6个月(含)	首发流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	1-6个月(含)	首发流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	1-6个月(含)	首发流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301260	格力博	2023-01-20	1-6个月(含)	首发流通受限	30.85	23.63	2,782	85,824.70	65,738.66	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内(含)	首发流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1-6个月(含)	首发流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023-06-13	1-6个月(含)	首发流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023-03-28	1-6个月(含)	首发流通受限	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月(含)	送股流通受限	-	25.10	97	-	2,434.70	-
301291	明阳电气	2023-06-21	1-6个月(含)	首发流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内(含)	首发流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023-06-29	1-6个月(含)	首发流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023-04-25	1-6个月(含)	首发流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023-06-19	1-6个月(含)	首发流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022-12-20	1-6个月(含)	首发流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	1-6个月(含)	首发流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤	2023-05-15	1-6个月(含)	首发流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-

	环境		月(含)	通受限							
301307	美利信	2023-04-14	1-6个月(含)	首发流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82		-
301315	威士顿	2023-06-13	1-6个月(含)	首发流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12		-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	1-6个月(含)	首发流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98		-
301320	豪江智能	2023-06-01	1-6个月(含)	首发流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-
301322	绿通科技	2023-02-27	1-6个月(含)	首发流通受限	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64		-
301322	绿通科技	2023-05-25	1-6个月(含)	送股流通受限	-	53.24	131	-	6,974.44		-
301323	新莱福	2023-05-29	1-6个月(含)	首发流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08		-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	1-6个月(含)	首发流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80		-
301332	德尔玛	2023-05-09	1-6个月(含)	首发流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06		-
301337	亚华电子	2023-05-16	1-6个月(含)	首发流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84		-
301345	涛涛车业	2023-03-10	1-6个月(含)	首发流通受限	73.45	46.64	186	13,661.70	8,675.04		-
301355	南王科技	2023-06-02	1-6个月(含)	首发流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25		-
301358	湖南裕能	2023-02-01	1-6个月(含)	首发流通受限	23.77	42.89	1,680	39,933.60	72,055.20		-
301360	荣旗科技	2023-04-17	1-6个月(含)	首发流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40		-
301373	凌玮科技	2023-01-20	1-6个月(含)	首发流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45		-
301376	致欧科技	2023-06-14	1-6个月(含)	首发流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20		-
301382	蜂助手	2023-05-09	1-6个月(含)	首发流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72		-
301386	未来电器	2023-03-21	1-6个月(含)	首发流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62		-
301387	光大同创	2023-04-10	1-6个月(含)	首发流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52		-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内(含)	首发流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68		-
301395	仁信新材	2023-06-21	1-6个月(含)	首发流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60		-

301397	溯联股份	2023-06-15	1-6个月(含)	首发流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	1-6个月(含)	首发流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	1-6个月(含)	首发流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	1-6个月(含)	首发流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	1-6个月(含)	首发流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	1-6个月(含)	首发流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内(含)	首发流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1-6个月(含)	首发流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内(含)	首发流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1-6个月(含)	首发流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	1-6个月(含)	首发流通受限	6.58	7.58	3,848	25,319.84	29,167.84	-
601065	江盐集团	2023-03-31	1-6个月(含)	首发流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	1-6个月(含)	首发流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023-03-30	1-6个月(含)	首发流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	1-6个月(含)	首发流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	1-6个月(含)	首发流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023-04-28	1-6个月(含)	首发流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023-04-13	1-6个月(含)	首发流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023-04-24	1-6个月(含)	首发流通受限	19.86	18.06	7,355	146,070.30	132,831.30	-
688334	西高院	2023-06-09	1-6个月(含)	首发流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023-04-11	1-6个月(含)	首发流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科	2023-05-12	1-6个月(含)	首发流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-

	飞测		月(含)	通受限							
688429	时创能源	2023-06-20	1-6个月(含)	首发流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023-04-07	1-6个月(含)	首发流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-
688443	智翔金泰	2023-06-13	1-6个月(含)	首发流通受限	37.88	29.49	1,708	64,699.04	50,368.92		-
688458	美芯晟	2023-05-15	1-6个月(含)	首发流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96		-
688469	中芯集成	2023-04-28	1-6个月(含)	首发流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00		-
688472	阿特斯	2023-06-02	1-6个月(含)	首发流通受限	11.10	17.04	4,988	55,366.80	84,995.52		-
688478	晶升股份	2023-04-13	1-6个月(含)	首发流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-
688479	友车科技	2023-05-04	1-6个月(含)	首发流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68		-
688484	南芯科技	2023-03-28	1-6个月(含)	首发流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68		-
688506	百利天恒	2022-12-28	1-6个月(含)	首发流通受限	24.70	71.38	10,935	270,094.50	780,540.30		-
688507	索辰科技	2023-04-10	1-6个月(含)	首发流通受限	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50		-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6个月(含)	送股流通受限	-	122.11	72	-	8,791.92		-
688512	慧智微	2023-05-08	1-6个月(含)	首发流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36		-
688523	航天环宇	2023-05-26	1-6个月(含)	首发流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688531	日联科技	2023-03-24	1-6个月(含)	首发流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62		-
688535	华海诚科	2023-03-28	1-6个月(含)	首发流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023-06-14	1-6个月(含)	首发流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50		-
688552	航天南湖	2023-05-08	1-6个月(含)	首发流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00		-
688562	航天软件	2023-05-15	1-6个月(含)	首发流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688576	西山科技	2023-05-30	1-6个月(含)	首发流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40		-
688581	安杰思	2023-05-12	1-6个月(含)	首发流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89		-

688582	芯动联科	2023-06-21	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023-05-25	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内 (含)	首发流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	1-6 个月 (含)	首发流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023-06-15	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	1-6 个月 (含)	首发流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023-06-16	1-6 个月 (含)	首发流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	1-6 个月 (含)	首发流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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 2020 年 2 月 14 日 (含) 后发行完毕的非公开发行股份，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

金额单位：人民币元

股票代码	股票	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌	复牌开盘单	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总	备注
------	----	------	------	------	----	-------	--------	--------	-------	----

	名称			单价	日期	价			额	
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	7,200	59,772.55	50,184.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金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

管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理制度和流程的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资

产净值的比例为 0.18% (2022 年 12 月 31 日: 0.16%)。

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 2023 年 6 月 30 日, 本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日, 本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评

估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 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、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 2023 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	146,024,714.93	-	-	-	146,024,714.93
结算备付金	3,204,540.44	-	-	-	3,204,540.44
存出保证金	159,250.96	-	-	-	159,250.96
交易性金融资产	-	-	2,372,638.58	1,159,905,493.33	1,162,278,131.91
应收申购款	-	-	-	530,135.05	530,135.05
应收清算款	-	-	-	779,312.05	779,312.05

资产总计	149,388,506.33	-	2,372,638.58	1,161,214,940.43	1,312,976,085.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,057,083.82	1,057,083.82
应付管理人报酬	-	-	-	1,599,521.56	1,599,521.56
应付托管费	-	-	-	266,586.94	266,586.94
应付销售服务费	-	-	-	1,898.85	1,898.85
应交税费	-	-	-	65,660.90	65,660.90
其他负债	-	-	-	2,188,645.05	2,188,645.05
负债总计	-	-	-	5,179,397.12	5,179,397.12
利率敏感度缺口	149,388,506.33	-	2,372,638.58	1,156,035,543.31	1,307,796,688.22
上年度末 2022 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	157,225,030.80	-	-	-	157,225,030.80
结算备付金	6,728,722.43	-	-	-	6,728,722.43
存出保证金	96,168.00	-	-	-	96,168.00
交易性金融资产	-	-	2,167,331.35	1,225,162,376.64	1,227,329,707.99
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	80,000,000.00
应收申购款	-	-	-	86,090.23	86,090.23
资产总计	244,049,921.23	-	2,167,331.35	1,225,248,466.87	1,471,465,719.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	603,778.50	603,778.50
应付管理人报酬	-	-	-	1,784,351.59	1,784,351.59
应付托管费	-	-	-	297,391.93	297,391.93
应付清算款	-	-	-	80,000,000.00	80,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,458.46	1,458.46
应交税费	-	-	-	65,661.29	65,661.29
其他负债	-	-	-	2,030,255.69	2,030,255.69
负债总计	-	-	-	84,782,897.46	84,782,897.46
利率敏感度缺口	244,049,921.23	-	2,167,331.35	1,140,465,569.41	1,386,682,821.99

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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.18% (2022 年 12 月 31 日: 0.16%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2022 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资(含存托凭证)比例范围为基金资产的60%-95%；权证投资比例范围为0%-3%；债券与货币市场工具的投资比例范围为5%-40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,159,905,493.33	88.69	1,225,162,376.64	88.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,159,905,493.33	88.69	1,225,162,376.64	88.35

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	
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	上年度末

		(2023 年 6 月 30 日)	(2022 年 12 月 31 日)
分析	1. 沪深 300 指数收益率上升 5%	46, 589, 758. 87	54, 614, 141. 10
	2. 沪深 300 指数收益率下降 5%	-46, 589, 758. 87	-54, 614, 141. 10

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1, 158, 884, 945. 87	1, 224, 138, 488. 48
第二层次	865, 434. 18	270, 094. 50
第三层次	2, 527, 751. 86	2, 921, 125. 01
合计	1, 162, 278, 131. 91	1, 227, 329, 707. 99

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、债券和基金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 2023 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,159,905,493.33	88.34
	其中：股票	1,159,905,493.33	88.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,372,638.58	0.18
	其中：债券	2,372,638.58	0.18
	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	149,229,255.37	11.37
8	其他各项资产	1,468,698.06	0.11
9	合计	1,312,976,085.34	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	5,089,009.90	0.39
B	采矿业	38,615,667.40	2.95
C	制造业	698,615,984.46	53.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,433,055.47	3.24
E	建筑业	24,169,035.15	1.85
F	批发和零售业	69,371,612.81	5.30
G	交通运输、仓储和邮政业	58,057,898.92	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,935,684.81	5.73
J	金融业	40,565,216.10	3.10
K	房地产业	67,693,379.40	5.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,556,442.48	0.88

N	水利、环境和公共设施管理业	4,518,182.57	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,058,897.00	0.54
Q	卫生和社会工作	6,950,156.86	0.53
R	文化、体育和娱乐业	10,275,270.00	0.79
S	综合	-	-
	合计	1,159,905,493.33	88.69

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	001979	招商蛇口	1,908,900	24,872,967.00	1.90
2	600325	华发股份	2,295,402	22,609,709.70	1.73
3	000858	五粮液	134,800	22,049,236.00	1.69
4	603019	中科曙光	423,500	21,556,150.00	1.65
5	000568	泸州老窖	101,409	21,252,284.13	1.63
6	600048	保利发展	1,551,090	20,210,702.70	1.55
7	002992	宝明科技	271,500	16,909,020.00	1.29
8	001269	欧晶科技	224,140	16,481,014.20	1.26
9	000425	徐工机械	2,427,100	16,431,467.00	1.26
10	300308	中际旭创	111,300	16,411,185.00	1.25
11	300394	天孚通信	151,106	16,142,653.98	1.23
12	603369	今世缘	296,500	15,655,200.00	1.20
13	688041	海光信息	228,517	15,600,855.59	1.19
14	601058	赛轮轮胎	1,363,800	15,533,682.00	1.19
15	600011	华能国际	1,636,200	15,151,212.00	1.16
16	000938	紫光股份	460,000	14,651,000.00	1.12
17	601800	中国交建	1,341,500	14,635,765.00	1.12
18	002959	小熊电器	174,957	14,608,909.50	1.12
19	600976	健民集团	188,000	14,492,920.00	1.11
20	002223	鱼跃医疗	399,743	14,386,750.57	1.10
21	000988	华工科技	370,100	14,067,501.00	1.08
22	300274	阳光电源	120,200	14,018,926.00	1.07
23	300502	新易盛	204,960	13,931,131.20	1.07
24	600079	人福医药	510,000	13,739,400.00	1.05
25	600761	安徽合力	646,830	12,891,321.90	0.99
26	002236	大华股份	652,200	12,880,950.00	0.98
27	002230	科大讯飞	181,700	12,348,332.00	0.94
28	600547	山东黄金	525,080	12,328,878.40	0.94
29	688072	拓荆科技	28,100	11,969,757.00	0.92

30	300360	炬华科技	656,651	11,740,919.88	0.90
31	600012	皖通高速	1,116,500	11,700,920.00	0.89
32	688111	金山办公	24,500	11,569,390.00	0.88
33	601226	华电重工	1,472,200	11,542,048.00	0.88
34	688212	澳华内镜	165,042	11,206,351.80	0.86
35	002142	宁波银行	441,190	11,162,107.00	0.85
36	300677	英科医疗	498,760	10,972,720.00	0.84
37	600887	伊利股份	383,000	10,846,560.00	0.83
38	600150	中国船舶	325,800	10,722,078.00	0.82
39	603368	柳药集团	430,700	10,642,597.00	0.81
40	300118	东方日升	414,500	10,623,635.00	0.81
41	601328	交通银行	1,783,000	10,341,400.00	0.79
42	300604	长川科技	217,600	10,333,824.00	0.79
43	002436	兴森科技	659,100	10,216,050.00	0.78
44	300026	红日药业	1,884,400	10,213,448.00	0.78
45	601991	大唐发电	3,025,600	10,014,736.00	0.77
46	600511	国药股份	257,400	9,999,990.00	0.76
47	002709	天赐材料	239,400	9,860,886.00	0.75
48	601319	中国人保	1,676,900	9,793,096.00	0.75
49	600489	中金黄金	923,700	9,541,821.00	0.73
50	601390	中国中铁	1,256,300	9,522,754.00	0.73
51	600426	华鲁恒升	305,400	9,354,402.00	0.72
52	688012	中微公司	59,770	9,351,016.50	0.72
53	601601	中国太保	353,700	9,189,126.00	0.70
54	600765	中航重机	340,340	9,022,413.40	0.69
55	601872	招商轮船	1,553,288	8,993,537.52	0.69
56	002463	沪电股份	424,700	8,893,218.00	0.68
57	601607	上海医药	392,500	8,795,925.00	0.67
58	601333	广深铁路	2,154,400	8,531,424.00	0.65
59	000063	中兴通讯	185,039	8,426,676.06	0.64
60	603737	三棵树	127,534	8,343,274.28	0.64
61	002837	英维克	278,460	8,337,092.40	0.64
62	688800	瑞可达	132,400	8,228,660.00	0.63
63	002179	中航光电	178,481	8,094,113.35	0.62
64	688017	绿的谐波	49,708	8,072,579.20	0.62
65	603885	吉祥航空	520,900	8,037,487.00	0.61
66	001965	招商公路	796,784	7,649,126.40	0.58
67	000683	远兴能源	1,005,500	7,229,545.00	0.55
68	003031	中瓷电子	53,200	7,081,984.00	0.54
69	605098	行动教育	178,300	7,058,897.00	0.54
70	300146	汤臣倍健	289,100	6,932,618.00	0.53
71	301060	兰卫医学	400,600	6,926,374.00	0.53
72	600428	中远海特	1,093,400	6,888,420.00	0.53

73	002555	三七互娱	196,700	6,860,896.00	0.52
74	002368	太极股份	166,300	6,846,571.00	0.52
75	600941	中国移动	73,300	6,838,890.00	0.52
76	688106	金宏气体	247,390	6,729,008.00	0.51
77	300002	神州泰岳	480,500	6,727,000.00	0.51
78	688981	中芯国际	129,990	6,567,094.80	0.50
79	600612	老凤祥	91,800	6,414,984.00	0.49
80	000333	美的集团	108,467	6,390,875.64	0.49
81	000951	中国重汽	375,600	6,328,860.00	0.48
82	002315	焦点科技	157,600	6,304,000.00	0.48
83	000543	皖能电力	943,800	6,229,080.00	0.48
84	603486	科沃斯	79,900	6,213,823.00	0.48
85	601816	京沪高铁	1,180,000	6,206,800.00	0.47
86	603444	吉比特	12,555	6,165,886.05	0.47
87	301039	中集车辆	455,100	6,020,973.00	0.46
88	601857	中国石油	788,000	5,886,360.00	0.45
89	600028	中国石化	902,800	5,741,808.00	0.44
90	002594	比亚迪	22,200	5,733,594.00	0.44
91	000521	长虹美菱	743,800	5,682,632.00	0.43
92	002558	巨人网络	315,800	5,662,294.00	0.43
93	600933	爱柯迪	242,500	5,647,825.00	0.43
94	603833	欧派家居	58,700	5,623,460.00	0.43
95	002867	周大生	316,200	5,622,036.00	0.43
96	002461	珠江啤酒	630,461	5,554,361.41	0.42
97	600461	洪城环境	678,000	5,539,260.00	0.42
98	688235	百济神州	50,700	5,531,877.00	0.42
99	002311	海大集团	117,700	5,513,068.00	0.42
100	300592	华凯易佰	201,600	5,487,552.00	0.42
101	600490	鹏欣资源	1,486,600	5,470,688.00	0.42
102	000539	粤电力 A	748,400	5,463,320.00	0.42
103	002517	恺英网络	344,000	5,414,560.00	0.41
104	002154	报喜鸟	967,400	5,340,048.00	0.41
105	000400	许继电气	231,400	5,333,770.00	0.41
106	002727	一心堂	202,000	5,332,800.00	0.41
107	300413	芒果超媒	155,400	5,316,234.00	0.41
108	605377	华旺科技	290,900	5,250,745.00	0.40
109	601088	中国神华	166,400	5,116,800.00	0.39
110	603477	巨星农牧	152,594	5,089,009.90	0.39
111	001215	千味央厨	76,100	5,059,889.00	0.39
112	605007	五洲特纸	333,000	5,048,280.00	0.39
113	000950	重药控股	743,000	5,000,390.00	0.38
114	002092	中泰化学	772,900	4,985,205.00	0.38
115	600373	中文传媒	372,300	4,959,036.00	0.38

116	600861	北京人力	212,400	4,927,680.00	0.38
117	002991	甘源食品	62,800	4,816,760.00	0.37
118	603237	五芳斋	156,100	4,734,513.00	0.36
119	600729	重庆百货	146,600	4,609,104.00	0.35
120	002372	伟星新材	224,340	4,607,943.60	0.35
121	002033	丽江股份	413,200	4,495,616.00	0.34
122	002891	中宠股份	185,500	4,477,970.00	0.34
123	600398	海澜之家	615,700	4,236,016.00	0.32
124	688506	百利天恒	10,935	780,540.30	0.06
125	688047	龙芯中科	6,243	716,633.97	0.05
126	301301	川宁生物	35,740	320,230.40	0.02
127	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
128	688063	派能科技	960	190,320.00	0.01
129	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
130	688249	晶合集成	7,355	132,831.30	0.01
131	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
132	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
133	688472	阿特斯	4,988	84,995.52	0.01
134	601128	常熟银行	11,655	79,487.10	0.01
135	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
136	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
137	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.01
138	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
139	301358	湖南裕能	1,680	72,055.20	0.01
140	301260	格力博	2,782	65,738.66	0.01
141	600600	青岛啤酒	600	62,178.00	0.00
142	603170	宝立食品	2,700	57,402.00	0.00
143	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
144	601728	中国电信	9,300	52,359.00	0.00
145	688443	智翔金泰	1,708	50,368.92	0.00
146	601298	青岛港	7,200	50,184.00	0.00
147	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
148	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
149	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
150	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
151	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
152	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
153	601061	中信金属	3,848	29,167.84	0.00
154	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
155	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
156	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
157	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
158	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00

159	301302	华如科技	699	25,723.20	0.00
160	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
161	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
162	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
163	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
164	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
165	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
166	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
167	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
168	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
169	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
170	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
171	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
172	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
173	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
174	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
175	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
176	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
177	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
178	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
179	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
180	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
181	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
182	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
183	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
184	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
185	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
186	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
187	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
188	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
189	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
190	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
191	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
192	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
193	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
194	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
195	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
196	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
197	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
198	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
199	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
200	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
201	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00

202	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
203	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
204	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
205	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
206	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
207	301345	涛涛车业	186	8,675.04	0.00
208	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
209	300957	贝泰妮	95	8,443.60	0.00
210	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
211	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
212	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
213	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
214	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
215	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
216	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
217	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
218	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
219	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
220	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
221	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
222	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
223	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
224	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
225	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
226	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	300274	阳光电源	31,049,138.00	2.24
2	600048	保利发展	28,600,077.44	2.06
3	000858	五粮液	28,348,961.00	2.04
4	000568	泸州老窖	25,521,195.50	1.84
5	600325	华发股份	22,289,873.00	1.61
6	001269	欧晶科技	20,784,624.20	1.50
7	603369	今世缘	20,161,507.00	1.45
8	000425	徐工机械	18,504,576.00	1.33
9	688041	海光信息	18,251,168.07	1.32
10	600436	片仔癀	17,897,175.00	1.29
11	300662	科锐国际	17,683,300.00	1.28
12	300026	红日药业	17,348,009.99	1.25
13	601800	中国交建	17,129,328.00	1.24
14	600761	安徽合力	16,955,075.00	1.22

15	002236	大华股份	16,929,910.75	1.22
16	600612	老凤祥	15,492,327.59	1.12
17	002422	科伦药业	14,948,428.24	1.08
18	603737	三棵树	14,848,814.30	1.07
19	603019	中科曙光	14,773,790.70	1.07
20	000938	紫光股份	14,526,839.77	1.05

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	600519	贵州茅台	56,879,876.00	4.10
2	600048	保利发展	33,139,705.00	2.39
3	000002	万科 A	27,310,632.00	1.97
4	300763	锦浪科技	25,564,075.00	1.84
5	603606	东方电缆	25,475,516.00	1.84
6	601369	陕鼓动力	20,931,474.45	1.51
7	688235	百济神州	20,731,060.11	1.50
8	001270	铖昌科技	20,158,471.81	1.45
9	601888	中国中免	19,857,965.34	1.43
10	300737	科顺股份	19,693,574.20	1.42
11	601100	恒立液压	19,622,657.92	1.42
12	002865	钧达股份	18,968,891.00	1.37
13	601668	中国建筑	18,407,193.60	1.33
14	000999	华润三九	18,231,875.20	1.31
15	300662	科锐国际	17,411,702.10	1.26
16	600436	片仔癀	16,972,412.00	1.22
17	301029	怡合达	16,564,670.40	1.19
18	601728	中国电信	16,538,123.97	1.19
19	300014	亿纬锂能	16,115,207.72	1.16
20	000739	普洛药业	16,056,627.00	1.16

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	1,896,386,541.18
卖出股票收入（成交）总额	1,918,291,738.91

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,372,638.58	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,372,638.58	0.18

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113063	赛轮转债	6,140	842,214.38	0.06
2	118027	宏图转债	4,650	623,650.99	0.05
3	127076	中宠转 2	4,952	611,815.39	0.05
4	127069	小熊转债	1,832	294,957.82	0.02

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 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报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规定的备选股票库

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	159,250.96
2	应收清算款	779,312.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	530,135.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,468,698.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113063	赛轮转债	842,214.38	0.06
2	118027	宏图转债	623,650.99	0.05
3	127076	中宠转 2	611,815.39	0.05
4	127069	小熊转债	294,957.82	0.02

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 (%)
融通领先成长混合 (LOF) A/B	67,971	13,205.33	5,252,089.69	0.59	892,327,076.63	99.41
融通领先成长混	910	4,797.47	-	-	4,365,695.94	100.00

合 (LOF) C						
合计	68,881	13,094.25	5,252,089.69	0.58	896,692,772.57	99.42

8.2 期末上市基金前十名持有人

融通领先成长混合 (LOF) A/B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	天津证券登记有限公司	5,157,907.00	8.07
2	叶风	1,964,660.00	3.07
3	王金明	1,562,700.00	2.45
4	李玲	1,120,646.00	1.75
5	张广城	550,546.00	0.86
6	高峰	411,977.00	0.64
7	张秀英	402,193.00	0.63
8	沈伟明	330,000.00	0.52
9	周杨东	309,000.00	0.48
10	许玉明	274,700.00	0.43

注：持有人为场内持有人。

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	融通领先成长混合 (LOF) A/B	13,240.67	0.00148
	融通领先成长混合 (LOF) C	-	-
	合计	13,240.67	0.00147

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	融通领先成长混合 (LOF) A/B	0
	融通领先成长混合 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通领先成长混合 (LOF) A/B	0
	融通领先成长混合 (LOF) C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通领先成长混合 (LOF) A/B	融通领先成长混合 (LOF) C
基金合同生效日 (2007 年 4 月 30 日) 基金份额总额	500,000,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	919,385,949.11	2,267,447.23

本报告期基金总申购份额	10,276,992.42	17,939,022.02
减：本报告期基金总赎回份额	32,083,775.21	15,840,773.31
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	897,579,166.32	4,365,695.94

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

1、2023 年 1 月 20 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》，本公司首席信息官由 Allen Yan（颜锡廉）变更为高翔，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2023 年 3 月 14 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》，新任杜国彦为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

3、2023 年 4 月，经本公司股东会表决通过，由江涛先生担任公司董事，吕秋梅女士不再担任公司董事。

4、2023 年 4 月 28 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》，新任商小虎为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

5、2023 年 4 月 28 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》，新任王智鲲为公司财务负责人，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

10.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自 2011 年 10 月 20 日以来为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理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及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 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，本基金的托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	1	1,349,112,973.47	35.55	1,242,940.55	35.55	-
西南证券	2	744,112,512.87	19.61	685,570.44	19.61	-
诚通证券	1	628,802,392.40	16.57	579,302.37	16.57	-
中金公司	1	516,561,069.60	13.61	475,913.67	13.61	-
申万宏源	2	216,941,908.82	5.72	199,859.52	5.72	-
广发证券	2	194,003,243.15	5.11	178,756.99	5.11	-
招商证券	1	145,370,058.75	3.83	133,931.38	3.83	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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

- 1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- 4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需

要，并能为本基金提供全面的信息服务；

6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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

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

(3) 交易单元变更情况

本报告期内交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	融通基金关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 7 日
2	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用“融通基金”名义进行诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
3	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	2023 年 1 月 20 日
4	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 27 日
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增博时财富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	2023 年 3 月 6 日
6	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	2023 年 3 月 14 日
7	融通基金管理有限公司关于公司董事变更情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 14 日
8	关于旗下部分开放式基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
9	关于旗下部分开放式基金新增诚通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 19 日
10	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	2023 年 4 月 28 日
11	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	2023 年 4 月 28 日
12	关于旗下部分开放式基金在长江证券股份有限公司开通定期定额投资、转换业务及参加申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 4 日
13	关于旗下部分开放式基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 18 日
14	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加珠海盈米基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 22 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《关于核准通宝证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》
- (二) 《融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- (三) 《融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- (四) 《融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》及其更新
- (五) 《融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书》
- (六) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (七) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所。

12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2023 年 8 月 25 日