

融通转型三动力灵活配置混合型  
证券投资基金  
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转型三动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	融通转型三动力灵活配置混合	
基金主代码	000717	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 1 月 16 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	124,566,733.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	000717	009828
下属分级基金的前端交易代码	000717	-
下属分级基金的后端交易代码	000718	-
报告期末下属分级基金的份额总额	123,721,438.21 份	845,295.61 份

## 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C
本期已实现收益	-7,333,009.77	-50,550.60
本期利润	23,540,242.45	169,976.73
加权平均基金份额本期利润	0.1880	0.2080
本期加权平均净值利润率	6.88%	7.71%
本期基金份额净值增长率	7.25%	6.98%
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	195,669,769.58	1,304,964.59
期末可供分配基金份额利润	1.5815	1.5438
期末基金资产净值	346,007,645.17	2,331,748.92
期末基金份额净值	2.797	2.759
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	179.70%	-11.35%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通转型三动力灵活配置混合 A/B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①-③	②-④
----	----------	----------	------------	------------	-----	-----

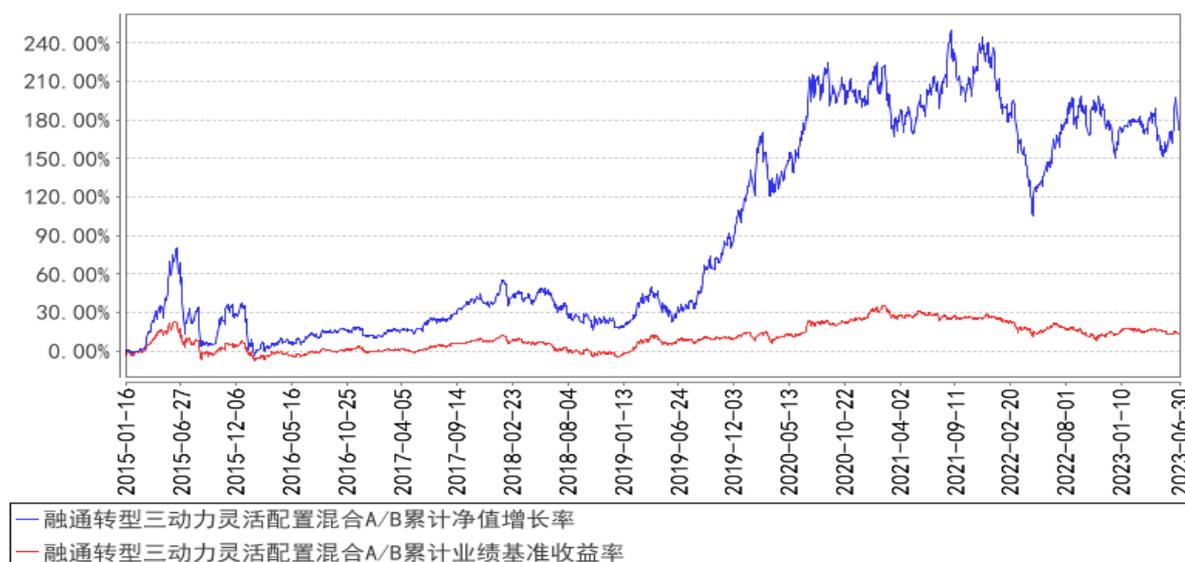
		准差②		准差④		
过去一个月	4.29%	1.93%	0.68%	0.43%	3.61%	1.50%
过去三个月	1.16%	1.72%	-2.10%	0.41%	3.26%	1.31%
过去六个月	7.25%	1.38%	0.34%	0.42%	6.91%	0.96%
过去一年	8.41%	1.43%	-6.53%	0.49%	14.94%	0.94%
过去三年	-1.03%	1.57%	-1.21%	0.60%	0.18%	0.97%
自基金合同生效起至今	179.70%	1.60%	13.52%	0.71%	166.18%	0.89%

融通转型三动力灵活配置混合 C

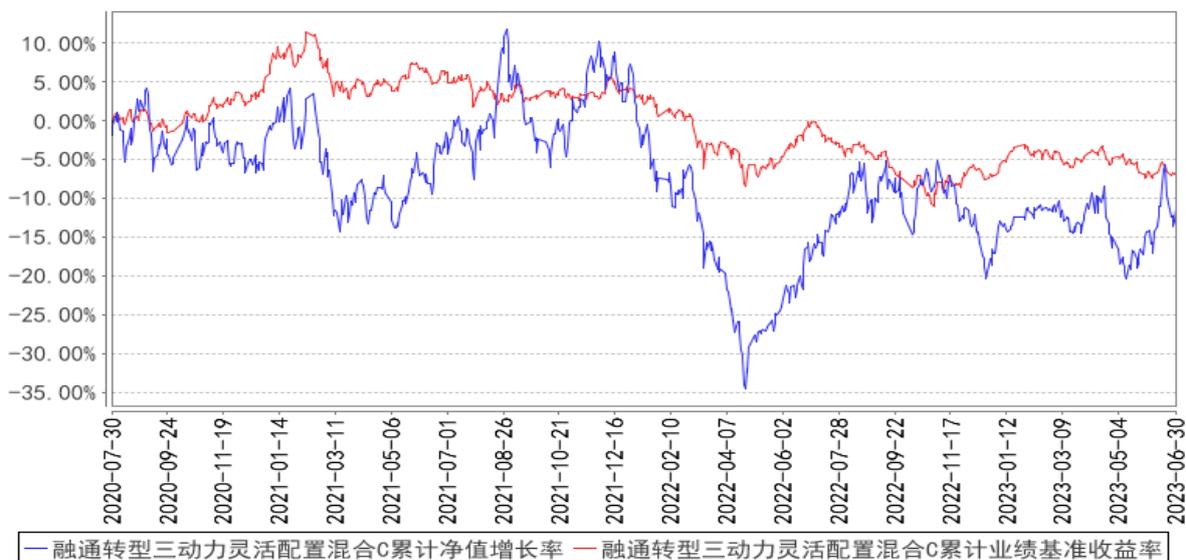
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.23%	1.94%	0.68%	0.43%	3.55%	1.51%
过去三个月	1.06%	1.72%	-2.10%	0.41%	3.16%	1.31%
过去六个月	6.98%	1.38%	0.34%	0.42%	6.64%	0.96%
过去一年	7.90%	1.43%	-6.53%	0.49%	14.43%	0.94%
自基金合同生效起至今	-11.35%	1.54%	-6.67%	0.57%	-4.68%	0.97%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

融通转型三动力灵活配置混合A/B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通转型三动力灵活配置混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2020 年 7 月 29 日增设 C 类份额，该类份额首次确认日为 2020 年 7 月 30 日，故本基金 C 类份额的统计区间为 2020 年 7 月 30 日至本报告期末。

### 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		
刘申	本基金的基金	2023-3-6	-	6	刘申奥先生，上海交通大学经济学硕士，6 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2017 年 10 月加

奥	经理				入融通基金管理有限公司，曾任行业研究员。现任融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张鹏	本基金的基金经理	2023-2-18	-	11	张鹏先生，复旦大学理学硕士，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，现任融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
林清源	本基金的基金经理	2018-6-22	2023-2-18	11	林清源先生，美国宾夕法尼亚大学系统工程硕士，11 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2011 年 7 月加入融通基金管理有限公司，历任互联网传媒行业研究员、家电行业研究员、计算机行业研究员、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长证券投资基金基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

全球逐步走出疫情阴影，新的技术进步出现，一些行业在周期位置和估值上变得有吸引力。

我们看好 AIGC 的发展，在持仓上做了一些倾斜。今年 AIGC 的发展有所加速。OpenAI 推出的 GPT 系列有效提高了人工智能的可用性，随着多模态大模型的持续进步，AIGC 有潜力引发新的信息技术革命，推动生产力提升和经济增长。我们将持续挖掘这个方向的投资机会。

我们认为新能源板块的风险收益比正在增加。在经历了产业链的供需再平衡后，一些细分环节出现了见底迹象，优秀企业的竞争优势更加突出，而且估值也逐渐趋于合理。我们将努力为投资者创造收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通转型三动力灵活配置混合 A/B 基金份额净值为 2.797 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.25%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%；

截至本报告期末融通转型三动力灵活配置混合 C 基金份额净值为 2.759 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.98%，同期业绩比较基准收益率为 0.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们看好国内经济的修复，企业盈利也应有所恢复。但地缘风险仍存，疫情对全球生产、消费的影响未完全消除，我们认为市场以结构性机会为主。

过去几年，我国供应链的优势在一些领域得到加强，开始具备全球竞争力，这些企业的成长空间变大；新技术的出现，也会产生新的商业模式和盈利空间。我们认为这些环节将出现不错的投资机会，管理人将仔细研究、深入挖掘，积极投资布局。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金

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
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	44,297,669.16	19,321,372.07
结算备付金		303,040.68	465,084.14
存出保证金		82,105.58	72,783.40
交易性金融资产	6.4.7.2	304,803,008.19	310,520,128.56
其中：股票投资		304,803,008.19	307,096,817.60
基金投资		-	-
债券投资		-	3,423,310.96
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		90,009.85	-
应收股利		-	-
应收申购款		204,935.19	114,074.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		349,780,768.65	330,493,442.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		294,173.21	-
应付赎回款		207,759.30	464,494.27
应付管理人报酬		429,532.74	428,664.37
应付托管费		71,588.78	71,444.07
应付销售服务费		921.82	1,014.56
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	437,398.71	425,451.57
负债合计		1,441,374.56	1,391,068.84

<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	124,566,733.82	126,177,697.84
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	223,772,660.27	202,924,676.02
净资产合计		348,339,394.09	329,102,373.86
负债和净资产总计		349,780,768.65	330,493,442.70

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 124,566,733.82 份，其中融通转型三动力灵活配置混合 A/B 类基金份额 123,721,438.21 份，基金份额净值 2.797 元；融通转型三动力灵活配置混合 C 类基金份额 845,295.61 份，基金份额净值 2.759 元。

## 6.2 利润表

会计主体：融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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
<b>一、营业总收入</b>		26,795,714.34	-125,071,494.32
1. 利息收入		57,249.34	71,562.06
其中：存款利息收入	6.4.7.13	57,249.34	71,562.06
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-4,413,182.72	-98,437,623.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,617,648.16	-100,259,877.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-991.59	-
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	1,205,457.03	1,822,254.36
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益	6.4.7.20	31,093,779.55	-26,808,232.87
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.21	57,868.17	102,799.76
<b>减：二、营业总支出</b>		3,085,495.16	3,402,729.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,562,811.34	2,747,714.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	427,135.20	457,952.51

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,479.99	101,617.02
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	90,068.63	95,445.54
<b>三、利润总额</b>		23,710,219.18	-128,474,224.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		23,710,219.18	-128,474,224.05
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		23,710,219.18	-128,474,224.05

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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）	126,177,697.84	-	202,924,676.02	329,102,373.86
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）	126,177,697.84	-	202,924,676.02	329,102,373.86
三、本期增减变动额	-1,610,964.02	-	20,847,984.25	19,237,020.23
（一）、综合收益总额	-	-	23,710,219.18	23,710,219.18
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,610,964.02	-	-2,862,234.93	-4,473,198.95
其中：1. 基金申购款	12,410,345.09	-	21,808,710.96	34,219,056.05
2. 基金赎回款	-14,021,309.11	-	-24,670,945.89	-38,692,255.00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	124,566,733.82	-	223,772,660.27	348,339,394.09
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）	149,965,777.01	-	353,781,020.23	503,746,797.24
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）	149,965,777.01	-	353,781,020.23	503,746,797.24
三、本期增减变动额	-30,270,260.82	-	-164,771,062.28	-195,041,323.10
（一）、综合收益总额	-	-	-128,474,224.05	-128,474,224.05
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-30,270,260.82	-	-36,296,838.23	-66,567,099.05
其中：1. 基金申购款	21,155,866.79	-	35,789,173.05	56,945,039.84
2. 基金赎回款	-51,426,127.61	-	-72,086,011.28	-123,512,138.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	119,695,516.19	-	189,009,957.95	308,705,474.14

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

融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 625 号《关于同意融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 664,422,720.01 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 044 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 664,827,527.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 404,807.19 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基

金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的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	44,297,669.16
等于：本金	44,292,815.73
加：应计利息	4,853.43
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	44,297,669.16

##### 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	282,927,198.95	-	304,803,008.19	21,875,809.24
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	282,927,198.95	-	304,803,008.19	21,875,809.24

#### 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	-
应付赎回费	103.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	353,452.09
其中：交易所市场	353,452.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,843.16
合计	437,398.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通转型三动力灵活配置混合 A/B

项目	本期 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	125,298,238.33	125,298,238.33
本期申购	11,928,018.80	11,928,018.80
本期赎回（以“-”号填列）	-13,504,818.92	-13,504,818.92
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	123,721,438.21	123,721,438.21

融通转型三动力灵活配置混合 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	879,459.51	879,459.51
本期申购	482,326.29	482,326.29
本期赎回（以“-”号填列）	-516,490.19	-516,490.19
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	845,295.61	845,295.61

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

##### 融通转型三动力灵活配置混合 A/B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	205,495,462.04	-3,959,686.96	201,535,775.08
本期利润	-7,333,009.77	30,873,252.22	23,540,242.45
本期基金份额交易产生的变动数	-2,492,682.69	-297,127.88	-2,789,810.57
其中：基金申购款	19,264,218.78	1,723,658.56	20,987,877.34
基金赎回款	-21,756,901.47	-2,020,786.44	-23,777,687.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	195,669,769.58	26,616,437.38	222,286,206.96

##### 融通转型三动力灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,414,433.90	-25,532.96	1,388,900.94
本期利润	-50,550.60	220,527.33	169,976.73
本期基金份额交易产生的变动数	-58,918.71	-13,505.65	-72,424.36
其中：基金申购款	754,607.59	66,226.03	820,833.62
基金赎回款	-813,526.30	-79,731.68	-893,257.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,304,964.59	181,488.72	1,486,453.31

#### 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	51,939.62
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	4,695.02
其他	614.70
合计	57,249.34

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	-5,617,648.16
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	-5,617,648.16

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	481,073,766.88
减：卖出股票成本总额	485,284,552.11
减：交易费用	1,406,862.93
买卖股票差价收入	-5,617,648.16

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	9,106.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-10,098.00
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	-991.59

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,433,607.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,404,828.00
减：应计利息总额	38,877.37
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-10,098.00

## 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	1,205,457.03
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,205,457.03

#### 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	31,093,779.55
股票投资	31,082,491.55
债券投资	11,288.00
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	31,093,779.55

#### 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	55,715.32
基金转换费收入	2,152.85
合计	57,868.17

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,725.47

账户维护费	9,000.00
合计	90,068.63

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 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 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	2,562,811.34	2,747,714.66
其中：支付销售机构的客户维护费	1,054,269.32	1,111,756.32

注：1、支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	427,135.20	457,952.51

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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		
	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C	合计
融通基金	-	258.78	258.78
合计	-	258.78	258.78
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		
	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C	合计
融通基金	-	201.94	201.94
合计	-	201.94	201.94

注：1、本基金 A/B 类基金份额不收取销售服务费。

2、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给融通基金，再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类的基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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	44,297,669.16	51,939.62	18,398,563.34	66,228.69

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-5-15	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	2023-3-31	1-6个月(含)	首发流通	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

				受限						
001287	中电港	2023-3-30	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.88	21.02	354	4,205.52	7,441.08	-
001324	长青科技	2023-5-12	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	2023-3-29	1-6 个月 (含)	首发流通受限	20.68	25.49	142	2,936.56	3,619.58	-
001360	南矿集团	2023-3-31	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	2023-3-30	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	2023-5-9	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	2023-6-15	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	2023-3-27	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	2023-3-1	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	2023-6-16	1-6 个月 (含)	首发流通受限	34.00	34.93	234	7,956.00	8,173.62	-
301202	朗威股份	2023-6-28	1 个月内 (含)	首发流通受限	25.82	25.82	2,706	69,868.92	69,868.92	-
301202	朗威股份	2023-6-28	1-6 个月 (含)	首发流通受限	25.82	25.82	301	7,771.82	7,771.82	-
301203	国泰环保	2023-3-28	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	2023-6-21	1-6 个月 (含)	首发流通受限	57.88	49.17	210	12,154.80	10,325.70	-
301225	恒勃股份	2023-6-8	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	2023-6-8	1-6 个月 (含)	首发流通受限	72.50	58.42	152	11,020.00	8,879.84	-
301260	格力博	2023-1-20	1-6 个月 (含)	首发流通受限	30.85	23.63	664	20,484.40	15,690.32	-
301261	恒工精密	2023-6-29	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	2023-6-29	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	2023-6-13	1-6 个月 (含)	首发流通受限	30.22	25.50	434	13,115.48	11,067.00	-
301281	科源制药	2023-3-28	1-6 个月 (含)	首发流通受限	44.18	25.10	222	9,807.96	5,572.20	-

301281	科源制药	2023-5-26	1-6 个月 (含)	送股流通受限	-	25.10	89	-	2,233.90	-
301291	明阳电气	2023-6-21	1-6 个月 (含)	首发流通受限	38.13	31.03	437	16,662.81	13,560.11	-
301292	海科新源	2023-6-29	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	2023-6-29	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	2023-4-25	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	2023-6-19	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	2,967	14,835.00	26,584.32	-
301303	真兰仪表	2023-2-13	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.80	22.32	608	16,294.40	13,570.56	-
301305	朗坤环境	2023-5-15	1-6 个月 (含)	首发流通受限	25.25	19.69	464	11,716.00	9,136.16	-
301307	美利信	2023-4-14	1-6 个月 (含)	首发流通受限	32.34	31.86	440	14,229.60	14,018.40	-
301315	威士顿	2023-6-13	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	2023-1-12	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	2023-6-1	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	2023-2-27	1-6 个月 (含)	首发流通受限	131.11	53.24	108	14,159.88	5,749.92	-
301322	绿通科技	2023-5-25	1-6 个月 (含)	送股流通受限	-	53.24	54	-	2,874.96	-
301323	新莱福	2023-5-29	1-6 个月 (含)	首发流通受限	39.06	39.36	188	7,343.28	7,399.68	-
301325	曼恩斯特	2023-5-4	1-6 个月 (含)	首发流通受限	76.80	107.95	182	13,977.60	19,646.90	-
301332	德尔玛	2023-5-9	1-6 个月 (含)	首发流通受限	14.81	13.73	724	10,722.44	9,940.52	-
301337	亚华电子	2023-5-16	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	2023-3-10	1-6 个月 (含)	首发流通受限	73.45	46.64	83	6,096.35	3,871.12	-
301355	南王科技	2023-6-2	1-6 个月 (含)	首发流通受限	17.55	16.75	532	9,336.60	8,911.00	-
301358	湖南裕能	2023-2-1	1-6 个月 (含)	首发流通	23.77	42.89	401	9,531.77	17,198.89	-

				受限						
301360	荣旗科技	2023-4-17	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	2023-1-20	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	2023-6-14	1-6 个月 (含)	首发流通受限	24.66	22.51	385	9,494.10	8,666.35	-
301382	蜂助手	2023-5-9	1-6 个月 (含)	首发流通受限	23.80	32.84	369	8,782.20	12,117.96	-
301386	未来电器	2023-3-21	1-6 个月 (含)	首发流通受限	29.99	23.79	344	10,316.56	8,183.76	-
301387	光大同创	2023-4-10	1-6 个月 (含)	首发流通受限	58.32	45.36	269	15,688.08	12,201.84	-
301395	仁信新材	2023-6-21	1 个月内 (含)	首发流通受限	26.68	26.68	4,598	122,674.64	122,674.64	-
301395	仁信新材	2023-6-21	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.68	26.68	511	13,633.48	13,633.48	-
301397	溯联股份	2023-6-15	1-6 个月 (含)	首发流通受限	53.27	40.20	245	13,051.15	9,849.00	-
301399	英特科技	2023-5-16	1-6 个月 (含)	首发流通受限	43.99	51.57	253	11,129.47	13,047.21	-
301408	华人健康	2023-2-22	1-6 个月 (含)	首发流通受限	16.24	16.95	767	12,456.08	13,000.65	-
301419	阿莱德	2023-2-2	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	2023-5-10	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	2023-3-10	1-6 个月 (含)	首发流通受限	19.99	16.90	443	8,855.57	7,486.70	-
301486	致尚科技	2023-6-30	1 个月内 (含)	首发流通受限	57.66	57.66	2,208	127,313.28	127,313.28	-
301486	致尚科技	2023-6-30	1-6 个月 (含)	首发流通受限	57.66	57.66	246	14,184.36	14,184.36	-
301488	豪恩汽电	2023-6-26	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	2023-6-26	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	2023-3-30	1-6 个月 (含)	首发流通受限	6.58	7.58	957	6,297.06	7,254.06	-
601065	江盐集团	2023-3-31	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.36	11.84	365	3,781.40	4,321.60	-
601133	柏诚股份	2023-3-31	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.66	12.26	338	3,941.08	4,143.88	-

603125	常青科技	2023-3-30	1-6 个月 (含)	首发流通受限	25.98	24.53	110	2,857.80	2,698.30	-
603135	中重科技	2023-3-29	1-6 个月 (含)	首发流通受限	17.80	17.89	331	5,891.80	5,921.59	-
603137	恒尚节能	2023-4-10	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	2023-4-28	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	2023-4-13	1-6 个月 (含)	首发流通受限	36.15	38.13	330	11,929.50	12,582.90	-
688249	晶合集成	2023-4-24	1-6 个月 (含)	首发流通受限	19.86	18.06	1,864	37,019.04	33,663.84	-
688307	中润光学	2023-2-8	1-6 个月 (含)	首发流通受限	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	-
688334	西高院	2023-6-9	1-6 个月 (含)	首发流通受限	14.16	16.21	679	9,614.64	11,006.59	-
688343	云天励飞	2023-3-28	1-6 个月 (含)	首发流通受限	43.92	50.67	5,158	226,539.36	261,355.86	-
688352	颀中科技	2023-4-11	1-6 个月 (含)	首发流通受限	12.10	12.07	917	11,095.70	11,068.19	-
688361	中科飞测	2023-5-12	1-6 个月 (含)	首发流通受限	23.60	64.67	329	7,764.40	21,276.43	-
688429	时创能源	2023-6-20	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	2023-4-7	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.66	31.50	295	7,864.70	9,292.50	-
688435	英方软件	2023-1-12	1-6 个月 (含)	首发流通受限	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	-
688443	智翔金泰	2023-6-13	1-6 个月 (含)	首发流通受限	37.88	29.49	442	16,742.96	13,034.58	-
688458	美芯晟	2023-5-15	1-6 个月 (含)	首发流通受限	75.00	90.76	127	9,525.00	11,526.52	-
688469	中芯集成	2023-4-28	1-6 个月 (含)	首发流通受限	5.69	5.41	3,561	20,262.09	19,265.01	-
688472	阿特斯	2023-6-2	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.10	17.04	1,294	14,363.40	22,049.76	-
688478	晶升股份	2023-4-13	1-6 个月 (含)	首发流通受限	32.52	42.37	394	12,812.88	16,693.78	-
688479	友车科技	2023-5-4	1-6 个月 (含)	首发流通受限	33.99	29.49	238	8,089.62	7,018.62	-
688484	南芯科技	2023-3-28	1-6 个月 (含)	首发流通受限	39.99	36.71	321	12,836.79	11,783.91	-
688507	索辰科技	2023-4-10	1-6 个月 (含)	首发流通	245.56	122.11	54	13,260.24	6,593.94	-

				受限						
688507	索辰科技	2023-6-20	1-6 个月 (含)	送股流通受限	-	122.11	26	-	3,174.86	-
688512	慧智微	2023-5-8	1-6 个月 (含)	首发流通受限	20.92	19.16	505	10,564.60	9,675.80	-
688523	航天环宇	2023-5-26	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	2023-3-24	1-6 个月 (含)	首发流通受限	152.38	135.97	116	17,676.08	15,772.52	-
688535	华海诚科	2023-3-28	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	2023-6-14	1-6 个月 (含)	首发流通受限	43.67	53.05	229	10,000.43	12,148.45	-
688552	航天南湖	2023-5-8	1-6 个月 (含)	首发流通受限	21.17	23.50	478	10,119.26	11,233.00	-
688562	航天软件	2023-5-15	1-6 个月 (含)	首发流通受限	12.68	22.31	636	8,064.48	14,189.16	-
688576	西山科技	2023-5-30	1-6 个月 (含)	首发流通受限	135.80	120.41	120	16,296.00	14,449.20	-
688581	安杰思	2023-5-12	1-6 个月 (含)	首发流通受限	125.80	118.03	82	10,315.60	9,678.46	-
688582	芯动联科	2023-6-21	1-6 个月 (含)	首发流通受限	26.74	40.68	379	10,134.46	15,417.72	-
688593	新相微	2023-5-25	1-6 个月 (含)	首发流通受限	11.18	14.59	740	8,273.20	10,796.60	-
688603	天承科技	2023-6-30	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	2023-6-30	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	2023-6-15	1-6 个月 (含)	首发流通受限	10.68	12.34	981	10,477.08	12,105.54	-
688623	双元科技	2023-5-31	1-6 个月 (含)	首发流通受限	125.88	86.79	79	9,944.52	6,856.41	-
688629	华丰科技	2023-6-16	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	2023-6-19	1-6 个月 (含)	首发流通受限	25.28	29.87	264	6,673.92	7,885.68	-

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，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

金份额持有人利益最大化。

董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略；审议重大事件、重大决策的风险评估意见，审批重大风险的解决方案，批准公司基本风险管理制度；审议公司风险管理报告。在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，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，本基金无债券投资 (2022 年 12 月 31 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 1.04%)。

#### 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 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	44,297,669.16	-	-	-	44,297,669.16
结算备付金	303,040.68	-	-	-	303,040.68
存出保证金	82,105.58	-	-	-	82,105.58
交易性金融资产	-	-	-	-304,803,008.19	304,803,008.19
应收申购款	-	-	-	204,935.19	204,935.19
应收清算款	-	-	-	90,009.85	90,009.85
资产总计	44,682,815.42	-	-	-305,097,953.23	349,780,768.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	207,759.30	207,759.30
应付管理人报酬	-	-	-	429,532.74	429,532.74
应付托管费	-	-	-	71,588.78	71,588.78
应付清算款	-	-	-	294,173.21	294,173.21
应付销售服务费	-	-	-	921.82	921.82
其他负债	-	-	-	437,398.71	437,398.71
负债总计	-	-	-	1,441,374.56	1,441,374.56
利率敏感度缺口	44,682,815.42	-	-	-303,656,578.67	348,339,394.09
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	19,321,372.07	-	-	-	19,321,372.07
结算备付金	465,084.14	-	-	-	465,084.14
存出保证金	72,783.40	-	-	-	72,783.40
交易性金融资产	3,423,310.96	-	-	-307,096,817.60	310,520,128.56
应收申购款	-	-	-	114,074.53	114,074.53
资产总计	23,282,550.57	-	-	-307,210,892.13	330,493,442.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	464,494.27	464,494.27
应付管理人报酬	-	-	-	428,664.37	428,664.37
应付托管费	-	-	-	71,444.07	71,444.07
应付销售服务费	-	-	-	1,014.56	1,014.56
其他负债	-	-	-	425,451.57	425,451.57
负债总计	-	-	-	1,391,068.84	1,391,068.84
利率敏感度缺口	23,282,550.57	-	-	-305,819,823.29	329,102,373.86

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

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 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 1.04%)，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。本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)占基金资产的 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金持有全部权证的市值不得超过基金净资产的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金净资产的 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	304,803,008.19	87.50	307,096,817.60	93.31
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	304,803,008.19	87.50	307,096,817.60	93.31

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数收益率上升 5%	13,067,129.74	10,949,440.90
	沪深 300 指数收益率下降 5%	-13,067,129.74	-10,949,440.90

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	302,587,943.26	305,915,792.96
第二层次	725,321.00	3,602,460.06
第三层次	1,489,743.93	1,001,875.54
合计	304,803,008.19	310,520,128.56

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期

间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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	304,803,008.19	87.14
	其中：股票	304,803,008.19	87.14
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	44,600,709.84	12.75
8	其他各项资产	377,050.62	0.11
9	合计	349,780,768.65	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	257,418,466.84	73.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	391,397.47	0.11
E	建筑业	30,646.02	0.01

F	批发和零售业	156,128.78	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,163,910.19	13.25
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	520,046.55	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	88,146.08	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	34,266.26	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	304,803,008.19	87.50

### 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	300308	中际旭创	109,700	16,175,265.00	4.64
2	688111	金山办公	33,370	15,757,981.40	4.52
3	300394	天孚通信	114,600	12,242,718.00	3.51
4	300502	新易盛	167,140	11,360,505.80	3.26
5	603019	中科曙光	215,800	10,984,220.00	3.15
6	688123	聚辰股份	199,554	10,720,040.88	3.08
7	688372	伟测科技	64,702	9,909,111.30	2.84
8	002230	科大讯飞	127,600	8,671,696.00	2.49
9	300604	长川科技	170,000	8,073,300.00	2.32
10	605117	德业股份	52,200	7,806,510.00	2.24
11	002837	英维克	250,640	7,504,161.60	2.15
12	301039	中集车辆	548,400	7,255,332.00	2.08
13	002920	德赛西威	45,600	7,104,936.00	2.04
14	002865	钧达股份	45,000	6,863,850.00	1.97
15	688409	富创精密	61,646	6,719,414.00	1.93
16	002709	天赐材料	155,300	6,396,807.00	1.84
17	300360	炬华科技	327,800	5,861,064.00	1.68
18	300260	新莱应材	144,000	5,690,880.00	1.63
19	000938	紫光股份	173,700	5,532,345.00	1.59
20	688019	安集科技	32,500	5,356,975.00	1.54
21	688385	复旦微电	100,000	5,010,000.00	1.44

22	002463	沪电股份	238,000	4,983,720.00	1.43
23	688063	派能科技	24,413	4,839,877.25	1.39
24	600522	中天科技	302,800	4,817,548.00	1.38
25	688052	纳芯微	28,000	4,434,360.00	1.27
26	002850	科达利	33,300	4,403,925.00	1.26
27	000951	中国重汽	253,900	4,278,215.00	1.23
28	688041	海光信息	60,031	4,098,316.37	1.18
29	300570	太辰光	74,100	4,054,011.00	1.16
30	002236	大华股份	204,700	4,042,825.00	1.16
31	688390	固德威	24,000	4,004,640.00	1.15
32	688127	蓝特光学	200,000	3,526,000.00	1.01
33	300274	阳光电源	30,000	3,498,900.00	1.00
34	601689	拓普集团	41,000	3,308,700.00	0.95
35	002475	立讯精密	100,000	3,245,000.00	0.93
36	603290	斯达半导	15,000	3,228,000.00	0.93
37	603986	兆易创新	30,000	3,187,500.00	0.92
38	002517	恺英网络	201,800	3,176,332.00	0.91
39	688392	骄成超声	28,000	3,107,720.00	0.89
40	300491	通合科技	106,400	3,053,680.00	0.88
41	688531	日联科技	20,116	2,985,972.52	0.86
42	601360	三六零	234,600	2,941,884.00	0.84
43	300624	万兴科技	24,800	2,905,320.00	0.83
44	601728	中国电信	500,000	2,815,000.00	0.81
45	000977	浪潮信息	55,700	2,701,450.00	0.78
46	300223	北京君正	30,000	2,649,300.00	0.76
47	002665	首航高科	700,000	2,646,000.00	0.76
48	300727	润禾材料	100,000	2,640,000.00	0.76
49	688348	昱能科技	14,000	2,629,620.00	0.75
50	300418	昆仑万维	61,700	2,485,276.00	0.71
51	000021	深科技	100,000	1,999,000.00	0.57
52	300567	精测电子	20,000	1,903,000.00	0.55
53	002594	比亚迪	6,700	1,730,409.00	0.50
54	300751	迈为股份	9,600	1,626,048.00	0.47
55	300693	盛弘股份	43,107	1,591,510.44	0.46
56	002436	兴森科技	100,000	1,550,000.00	0.44
57	002916	深南电路	18,400	1,386,808.00	0.40
58	002368	太极股份	30,000	1,235,100.00	0.35
59	000625	长安汽车	69,900	903,807.00	0.26
60	688048	长光华芯	8,891	840,377.32	0.24
61	002315	焦点科技	18,500	740,000.00	0.21
62	600066	宇通客车	47,900	706,046.00	0.20
63	001286	陕西能源	37,667	391,397.47	0.11
64	601965	中国汽研	18,700	386,155.00	0.11

65	688343	云天励飞	5,158	261,355.86	0.08
66	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.06
67	301317	鑫磊股份	6,936	186,571.14	0.05
68	301358	湖南裕能	4,007	175,898.95	0.05
69	688582	芯动联科	3,783	174,895.12	0.05
70	688562	航天软件	6,354	171,148.26	0.05
71	301260	格力博	6,638	162,471.50	0.05
72	301419	阿莱德	3,292	150,811.36	0.04
73	301399	英特科技	2,524	148,171.71	0.04
74	301307	美利信	4,394	147,703.14	0.04
75	688373	盟科药业	16,607	141,989.85	0.04
76	301486	致尚科技	2,454	141,497.64	0.04
77	688146	中船特气	3,300	137,916.90	0.04
78	301395	仁信新材	5,109	136,308.12	0.04
79	301408	华人健康	7,666	132,767.29	0.04
80	301387	光大同创	2,687	131,481.78	0.04
81	688484	南芯科技	3,204	130,563.51	0.04
82	688593	新相微	7,400	124,749.20	0.04
83	688522	纳睿雷达	2,282	122,132.64	0.04
84	688352	颀中科技	9,168	121,961.63	0.04
85	688458	美芯晟	1,270	121,448.83	0.03
86	301141	中科磁业	2,617	119,750.28	0.03
87	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
88	688073	毕得医药	1,497	105,957.66	0.03
89	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.03
90	301332	德尔玛	7,235	102,982.71	0.03
91	688507	索辰科技	786	101,993.58	0.03
92	688433	华曙高科	2,949	99,528.50	0.03
93	688581	安杰思	814	99,341.14	0.03
94	301322	绿通科技	1,616	90,266.98	0.03
95	301373	凌玮科技	2,764	89,376.38	0.03
96	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.02
97	301323	新莱福	1,879	80,535.43	0.02
98	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.02
99	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.02
100	301439	泓淋电力	4,426	78,543.42	0.02
101	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.02
102	301202	朗威股份	3,007	77,640.74	0.02
103	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
104	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
105	688623	双元科技	789	72,084.11	0.02
106	688480	赛恩斯	2,302	71,269.92	0.02
107	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.02

108	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.01
109	301269	华大九天	291	35,746.44	0.01
110	688249	晶合集成	1,864	33,663.84	0.01
111	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.01
112	301301	川宁生物	2,967	26,584.32	0.01
113	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.01
114	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
115	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.01
116	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.01
117	688472	阿特斯	1,294	22,049.76	0.01
118	688361	中科飞测	329	21,276.43	0.01
119	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.01
120	301325	曼恩斯特	182	19,646.90	0.01
121	688469	中芯集成	3,561	19,265.01	0.01
122	301391	卡莱特	149	17,458.33	0.01
123	301230	泓博医药	377	16,927.30	0.00
124	688478	晶升股份	394	16,693.78	0.00
125	301165	锐捷网络	255	15,738.60	0.00
126	301363	美好医疗	340	14,956.60	0.00
127	688576	西山科技	120	14,449.20	0.00
128	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
129	301303	真兰仪表	608	13,570.56	0.00
130	301291	明阳电气	437	13,560.11	0.00
131	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
132	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
133	688443	智翔金泰	442	13,034.58	0.00
134	301280	珠城科技	360	12,873.60	0.00
135	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
136	301195	北路智控	263	12,245.28	0.00
137	688543	国科军工	229	12,148.45	0.00
138	301382	蜂助手	369	12,117.96	0.00
139	688620	安凯微	981	12,105.54	0.00
140	301315	威斯顿	226	11,553.12	0.00
141	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
142	688552	航天南湖	478	11,233.00	0.00
143	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
144	301262	海看股份	434	11,067.00	0.00
145	688334	西高院	679	11,006.59	0.00
146	301367	怡和嘉业	72	10,680.48	0.00
147	301267	华夏眼科	172	10,483.40	0.00
148	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
149	301210	金杨股份	210	10,325.70	0.00
150	301397	溯联股份	245	9,849.00	0.00

151	688512	慧智微	505	9,675.80	0.00
152	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
153	301290	东星医疗	286	9,166.30	0.00
154	301305	朗坤环境	464	9,136.16	0.00
155	301355	南王科技	532	8,911.00	0.00
156	301232	飞沃科技	152	8,879.84	0.00
157	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
158	301121	紫建电子	174	8,811.36	0.00
159	301376	致欧科技	385	8,666.35	0.00
160	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
161	301386	未来电器	344	8,183.76	0.00
162	301170	锡南科技	234	8,173.62	0.00
163	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
164	301265	华新环保	688	7,994.56	0.00
165	688631	莱斯信息	264	7,885.68	0.00
166	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
167	301281	科源制药	311	7,806.10	0.00
168	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
169	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
170	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
171	001287	中电港	354	7,441.08	0.00
172	601061	中信金属	957	7,254.06	0.00
173	301276	嘉曼服饰	277	7,063.50	0.00
174	688479	友车科技	238	7,018.62	0.00
175	301327	华宝新能	79	6,249.69	0.00
176	603135	中重科技	331	5,921.59	0.00
177	601065	江盐集团	365	4,321.60	0.00
178	601133	柏诚股份	338	4,143.88	0.00
179	301345	涛涛车业	83	3,871.12	0.00
180	301283	聚胶股份	105	3,725.40	0.00
181	001328	登康口腔	142	3,619.58	0.00
182	301349	信德新材	69	3,459.66	0.00
183	603125	常青科技	110	2,698.30	0.00
184	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
185	600363	联创光电	5	185.50	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	688123	聚辰股份	16,382,447.97	4.98
2	688111	金山办公	15,649,205.57	4.76
3	300308	中际旭创	13,026,751.00	3.96
4	003021	兆威机电	9,739,625.00	2.96

5	688063	派能科技	9,697,542.22	2.95
6	688032	禾迈股份	9,207,419.02	2.80
7	603019	中科曙光	9,193,510.00	2.79
8	002920	德赛西威	9,160,804.05	2.78
9	002230	科大讯飞	9,006,526.06	2.74
10	688052	纳芯微	8,886,415.64	2.70
11	300394	天孚通信	8,324,437.00	2.53
12	002837	英维克	8,232,766.50	2.50
13	002865	钧达股份	8,223,442.10	2.50
14	605117	德业股份	8,143,603.00	2.47
15	300604	长川科技	7,764,161.84	2.36
16	688372	伟测科技	7,159,344.33	2.18
17	688041	海光信息	7,141,467.43	2.17
18	301039	中集车辆	6,910,837.00	2.10
19	688409	富创精密	6,716,268.99	2.04
20	688385	复旦微电	6,663,519.68	2.02
21	000938	紫光股份	6,631,587.12	2.02

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	002727	一心堂	27,251,812.00	8.28
2	603883	老百姓	21,580,604.57	6.56
3	002885	京泉华	19,037,643.00	5.78
4	603236	移远通信	18,555,374.90	5.64
5	605266	健之佳	16,789,934.16	5.10
6	300122	智飞生物	16,608,469.68	5.05
7	300502	新易盛	15,396,437.76	4.68
8	000661	长春高新	15,147,585.19	4.60
9	688636	智明达	14,591,332.64	4.43
10	300699	光威复材	14,511,978.50	4.41
11	003021	兆威机电	12,191,373.00	3.70
12	300593	新雷能	12,187,726.40	3.70
13	300496	中科创达	11,489,548.00	3.49
14	688268	华特气体	11,354,377.30	3.45
15	000738	航发控制	9,768,649.93	2.97
16	002179	中航光电	9,742,758.76	2.96
17	600765	中航重机	8,629,694.40	2.62
18	600026	中远海能	8,487,590.00	2.58
19	605068	明新旭腾	6,839,140.00	2.08
20	600363	联创光电	6,745,051.00	2.05
21	601728	中国电信	6,735,256.00	2.05

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	451,908,251.15
卖出股票收入（成交）总额	481,073,766.88

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

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	82,105.58
2	应收清算款	90,009.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	204,935.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	377,050.62

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 (%)
融通转型三动力灵活配置混合 A/B	38,530	3,211.04	10,338,229.84	8.36	113,383,208.37	91.64
融通转型三动力灵活配置混合 C	897	942.36	-	-	845,295.61	100.00
合计	39,427	3,159.43	10,338,229.84	8.30	114,228,503.98	91.70

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	44,635.99	0.03608
	融通转型三动力灵活配置混合 C	4.22	0.00050
	合计	44,640.21	0.03584

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通转型三动力灵活配置混合 A/B	融通转型三动力灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 1 月 16 日）基金份额总额	664,827,527.20	-
本报告期期初基金份额总额	125,298,238.33	879,459.51
本报告期基金总申购份额	11,928,018.80	482,326.29
减：本报告期基金总赎回份额	13,504,818.92	516,490.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	123,721,438.21	845,295.61

§ 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》，新任王智鲲鹏为公司财务负责人，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），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 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 (%)	
信达证券	2	301,891,566.82	32.74	278,144.77	32.74	-
国海证券	2	234,897,731.02	25.47	216,412.01	25.47	-
东吴证券	2	230,489,548.12	24.99	212,347.84	24.99	-
德邦证券	2	98,689,229.42	10.70	90,915.98	10.70	-
中金公司	2	31,131,812.15	3.38	28,681.96	3.38	-
民生证券	2	21,774,998.85	2.36	20,061.74	2.36	-
上海证券	1	2,951,358.46	0.32	2,719.16	0.32	-
国金证券	1	317,021.55	0.03	292.08	0.03	-
财达证券	1	-	-	-	-	-

财信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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

无。

#### 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 (%)
信达证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	3,394,730.00	100.00	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通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	2023-1-7
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开通定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-1-10
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海天天、北京中植开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-1-10
4	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在部分销售机构开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-1-10
5	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	2023-1-19
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	2023-1-20
7	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开通转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-2-6
8	融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-2-18
9	关于旗下部分开放式基金新增海通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-2-20
10	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	2023-2-27

11	融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-3-6
12	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	2023-3-6
13	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	2023-3-14
14	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	2023-4-14
15	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	2023-4-18
16	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	2023-4-19
17	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	2023-4-28
18	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	2023-4-28
19	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	2023-5-18
20	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	2023-5-22
21	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海大智慧基金销售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	2023-6-6

## § 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) 中国证监会批准融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 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

2023 年 8 月 25 日