

财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：财通证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 02 月 05 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金	
基金简称	财通资管量化选股股票发起式	
基金主代码	026520	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 02 月 05 日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	326,001,666.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通资管量化选股股票发起式 A	财通资管量化选股股票发起式 C
下属分级基金的交易代码	026520	026521
报告期末下属分级基金的份额总额	168,578,825.30 份	157,422,840.74 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化多因子模型精选股票,在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、资产支持证券投资策略;5、金融衍生产品投资策略;6、融资策略
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金可以投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		财通证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋巍峰	郭明
	联系电话	0571-89720101	(010) 66105799
	电子邮箱	jiangwf@ctzg.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-116-7888	95588
传真		021-68753502	(010) 66105798
注册地址		浙江省杭州市上城区白云路 26 号 143 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区栖霞路 26 弄富汇	北京市西城区复兴门内大街 55

	大厦 B 座 8、9 层	号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	马晓立	廖林

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通证券资产管理有限公司	浙江省杭州市上城区新业路 300 号中国人寿大厦 2 幢 22 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日）	
	财通资管量化选股股票发起式 A	财通资管量化选股股票发起式 C
本期已实现收益	-2,823,105.54	-3,240,609.68
本期利润	-16,327,632.82	-16,620,415.00
加权平均基金份额本期利润	-0.0790	-0.0806
本期加权平均净值利润率	-8.23%	-8.40%
本期基金份额净值增长率	-8.31%	-8.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	财通资管量化选股股票发起式 A	财通资管量化选股股票发起式 C
期末可供分配利润	-14,015,765.82	-13,319,287.73
期末可供分配基金份额利润	-0.0831	-0.0846
期末基金资产净值	154,563,059.48	144,103,553.01
期末基金份额净值	0.9169	0.9154
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
	财通资管量化选股股票发起式 A	财通资管量化选股股票发起式 C
基金份额累计净值增长率	-8.31%	-8.46%

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、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金合同于 2026 年 02 月 05 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满半年。

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

财通资管量化选股股票发起式 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	-1.44%	1.25%	17.61%	1.56%	-19.05%	-0.31%
自基金合同生 效起至今	-8.31%	1.29%	8.44%	1.58%	-16.75%	-0.29%

财通资管量化选股股票发起式 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	-1.55%	1.25%	17.61%	1.56%	-19.16%	-0.31%
自基金合同生 效起至今	-8.46%	1.29%	8.44%	1.58%	-16.90%	-0.29%

注：1、业绩比较基准：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

财通资管量化选股股票发起式 A



财通资管量化选股股票发起式 C



注：1、本基金合同于 2026 年 02 月 05 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月，报告期末本基金未建仓完毕。

§ 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

财通证券资产管理有限公司系财通证券股份有限公司的全资子公司，注册资本 5 亿元人民币。

2015 年 12 月，公司获准开展公开募集证券投资基金管理业务。截至 2026 年 06 月 30 日，公司共管理 74 只基金，分别为财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管睿智 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、财通资管鑫盛 6 个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管瑞享 12 个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿 12 个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管价值发现混合型证券投资基金、财通资管行业精选混合型证券投资基金、财通资管鸿盛 12 个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、财通资管丰乾 39 个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金、财通资管睿慧 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿安 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管消费升级一年持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿启 90 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、财通资管鸿享 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管双盈债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、财通资管健康产业混合型证券投资基金、财通资管鸿佳 60 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管新聚益 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管稳兴增益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿商中短债债券型证券投资基金、财通资管双福 9 个月持有期债券型发起式证券投资基金、财通资管睿达一年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管稳兴丰益六个月持有期混合型证券投资基金、财通资管鸿慧中短债债券型发起式证券投资基金、财通资管通达稳健 3 个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、财通资管睿盈债券型证券投资基金、财通资管均衡臻选混合型证券投资基金、财通资管双安债券型证券投资基金、财通资管数字经济混合型发起式证券投资基金、财通资管现金聚财货币市场基金、财通资管臻享成长混合型证券投资基金、财通资管睿兴债券型证券投资基金、财通资管品质消费混合型发起式证券投资基金、财通资管睿安债券型证券投资基金、财

通资管医疗保健混合型证券投资基金、财通资管康恒平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、财通资管鸿兴 60 天持有期债券型证券投资基金、财通资管双鑫一年持有期债券型证券投资基金、财通资管产业优选混合型发起式证券投资基金、财通资管通达稳利 3 个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）、财通资管创新医药混合型证券投资基金、财通资管创新成长混合型证券投资基金、财通资管中证 1000 指数增强型证券投资基金、财通资管康泽稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、财通资管睿丰债券型证券投资基金、财通资管先进制造混合型发起式证券投资基金、财通资管中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、财通资管鸿曜 90 天持有期债券型证券投资基金、财通资管通达稳鑫 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金、财通资管优质研选混合型发起式证券投资基金、财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金、财通资管周期研选混合型发起式证券投资基金、财通资管消费研选混合型发起式证券投资基金、财通资管双泰债券型证券投资基金和财通资管科技研选混合型发起式证券投资基金。

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		
杨宸祎	本基金基金经理和财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。	2026 年 02 月 05 日	—	4	硕士研究生学历、硕士学位。曾在华创证券有限责任公司工作。2025 年 5 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任量化及多资产投资部研究员，现任量化及多资产投资部基金经理。
盛博文	本基金基金经理助理、财通资管双泰债券型证券投资基金和财通资管中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理助理。	2026 年 02 月 05 日	—	3	博士研究生学历、博士学位。曾在中信期货有限公司工作。2025 年 9 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任量化及多资产投资部研究员，现任量化及多资产投资部基金经理助理。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金

经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》相关规定。

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

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

二季度期间，宽基指数的上涨在一定程度上掩盖了市场底层的结构性分化。尽管中证 500 与科创 50 等指数涨幅显著，但这种表现主要由少数高权重科技股的盈利预期驱动，导致市场交易拥挤度攀升至历史极值，少数热门板块成交占比一度突破 50%。在极端拥挤度与高估值背景下，资产价格

对地缘冲突及海外紧缩等利空因素的敏感度大幅提升，而传统金融、消费等板块的活跃度则受到持续压制。进入 7 月，随着中报业绩预告密集披露，市场定价逻辑正从“产业预期驱动”向“真实盈利验证”发生深刻切换，缺乏实质性业绩支撑的板块或面临估值再审视的压力。因此，我们在操作上严格控制了对单一高估值赛道的风险暴露，利用多维因子信号，在全市场范围内客观捕捉估值与盈利预期相匹配的优质标的，力求在极端分化与不确定性中实现超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末财通资管量化选股股票发起式 A 份额净值为 0.9169 元，本报告期财通资管量化选股股票发起式 A 份额净值增长率为-8.31%，同期业绩比较基准收益率为 8.44%；截至本报告期末财通资管量化选股股票发起式 C 份额净值为 0.9154 元，本报告期财通资管量化选股股票发起式 C 份额净值增长率为-8.46%，同期业绩比较基准收益率为 8.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年 A 股预计或将在内外宏观预期的博弈中维持宽幅震荡，资金或将加速向具备真实盈利支撑的低估值板块集中。国内二季度实际 GDP 增速放缓至 4.3%，经济呈现显著的“K 型分化”——外需与生产偏强，而内需与消费偏弱。从中报预告来看，A 股整体盈利动能持续强化且结构特征清晰。上游资源品受益于供需紧平衡，非银金融等低估值资产中报业绩表现亮眼，在目前较低的估值水位下，具备相比较而言更高的安全边际与性价比。同时高景气科技制造板块预计或将维持高增速，但内部分化加剧，市场定价将锚定其实际业绩兑现能力。因此，后续需重点关注 A 股整体的盈利质量、宏观政策对内需的提振效果，以及美国核心通胀回落斜率对全球利率中枢的实质性影响，这些因素将共同决定下半年结构性行情的演绎方向与持续性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人设有估值工作小组，估值工作小组成员由公司研究及投资部门、合规稽核部、风险管理部、运营保障部等人员组成。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据及预期信用损失数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内无利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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

报告期内无需要说明的相关情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——财通证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对财通证券资产管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	21,321,776.67
结算备付金		117,294.04
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	283,391,180.68
其中：股票投资		283,391,180.68
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		28,801.18
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		304,859,052.57
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 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		-
应付赎回款		5,734,696.66
应付管理人报酬		308,671.43
应付托管费		38,583.93
应付销售服务费		51,073.77
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	6.4.7.6	59,414.29

负债合计		6,192,440.08
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	326,001,666.04
未分配利润	6.4.7.8	-27,335,053.55
净资产合计		298,666,612.49
负债和净资产总计		304,859,052.57

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，财通资管量化选股股票发起式 A 基金份额净值 0.9169 元，财通资管量化选股股票发起式 C 基金份额净值 0.9154 元；基金份额总额 326,001,666.04 份，下属分级基金的份额总额分别为：财通资管量化选股股票发起式 A 基金份额总额 168,578,825.30 份，财通资管量化选股股票发起式 C 基金份额总额 157,422,840.74 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间。本基金合同生效日为 2026 年 02 月 05 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日） 至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-30,424,049.75
1. 利息收入		169,740.99
其中：存款利息收入	6.4.7.9	135,823.19
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		33,917.80
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,898,049.78
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-8,259,498.87
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	3,361,449.09
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-26,884,332.60
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. 15	1,188,591.64
减：二、营业总支出		2,523,998.07
1. 管理人报酬		1,906,221.48
2. 托管费		238,277.68
3. 销售服务费		317,479.78
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. 16	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6. 4. 7. 17	62,019.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,948,047.82
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,948,047.82
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-32,948,047.82

6.3 净资产变动表

会计主体：财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	485,153,260.38	-	485,153,260.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-159,151,594.34	-27,335,053.55	-186,486,647.89
（一）、综合收益总额	-	-32,948,047.82	-32,948,047.82
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-159,151,594.34	5,612,994.27	-153,538,600.07
其中：1. 基金申购款	40,817,749.63	-1,208,937.44	39,608,812.19
2. 基金赎回款	-199,969,343.97	6,821,931.71	-193,147,412.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	326,001,666.04	-27,335,053.55	298,666,612.49

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：

钱慧

刘博

刘博

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

财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金（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[2025]2837号《关于准予财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管量化选股股票型发起式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 485,075,388.46 元，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报(验)字(26)第 00042 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2026 年 2 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 485,153,260.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 77,871.92 份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者通过直销机构以外的其他销售机构认购/申购时收取前端认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额，投资者通过直销机构认购/申购 A 类基金份额时不收取前端认购/申购费用。在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从直销机构以外的其他销售机构保有的本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额（其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额，计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额，持续持有期限超过一年继续计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者）。

本基金的投资范围主要为国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、货币市场工具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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于 80%,其中,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的保证金后,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人财通证券资产管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号-年度报告和中期报告》以及参考本基金的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其允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 02 月 05 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 02 月 05 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申

购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交

易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财政部及税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年第10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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应税交易，资管产品管理人为纳税人。自2026年1月1日至

2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税。

自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	5,430.86
等于：本金	5,429.98
加：应计利息	0.88
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
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	21,316,345.81
等于：本金	21,316,105.50
加：应计利息	240.31
合计	21,321,776.67

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	310,275,513.28	—	283,391,180.68	-26,884,332.60
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	310,275,513.28	—	283,391,180.68	-26,884,332.60

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,899.05
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—

预提费用	57,515.24
合计	59,414.29

6.4.7.7 实收基金

财通资管量化选股股票发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	240,285,327.67	240,285,327.67
本期申购	12,286,445.55	12,286,445.55
本期赎回（以“-”号填列）	-83,992,947.92	-83,992,947.92
本期末	168,578,825.30	168,578,825.30

财通资管量化选股股票发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	244,867,932.71	244,867,932.71
本期申购	28,531,304.08	28,531,304.08
本期赎回（以“-”号填列）	-115,976,396.05	-115,976,396.05
本期末	157,422,840.74	157,422,840.74

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金自 2026 年 1 月 26 日至 2026 年 1 月 30 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 485,075,388.46 元。根据《财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 77,871.92 元在本基金成立后，折算为 77,871.92 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

财通资管量化选股股票发起式 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,823,105.54	-13,504,527.28	-16,327,632.82
本期基金份额交易产生的变动数	1,336,945.75	974,921.25	2,311,867.00
其中：基金申购款	-113,641.87	-346,488.06	-460,129.93

基金赎回款	1,450,587.62	1,321,409.31	2,771,996.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,486,159.79	-12,529,606.03	-14,015,765.82

财通资管量化选股股票发起式 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,240,609.68	-13,379,805.32	-16,620,415.00
本期基金份额交易产生的变动数	1,609,813.57	1,691,313.70	3,301,127.27
其中：基金申购款	-268,149.93	-480,657.58	-748,807.51
基金赎回款	1,877,963.50	2,171,971.28	4,049,934.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,630,796.11	-11,688,491.62	-13,319,287.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	10,397.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,131.44
结算备付金利息收入	117,294.04
其他	-
合计	135,823.19

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	898,586,690.36
减：卖出股票成本总额	905,329,562.07
减：交易费用	1,516,627.16
买卖股票差价收入	-8,259,498.87

6.4.7.10.2 股票投资收益--证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,361,449.09
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,361,449.09

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 02 月 05 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-26,884,332.60

—股票投资	-26,884,332.60
—债券投资	—
—资产支持证券投资	—
—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	-26,884,332.60

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,157,923.26
基金转换费收入	30,668.38
合计	1,188,591.64

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	13,272.86
信息披露费	44,242.38
证券出借违约金	—
汇划手续费	3,703.89
开户费	800.00
合计	62,019.13

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

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期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
财通证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
财通证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、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 2026年02月05日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
财通证券股份有限公司	1,320,552,431.48	62.47%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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 2026年02月05日（基金合同生效日）至2026年06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
财通证券股份有限公司	582,074.03	62.41%	-	-

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，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年02月05日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,906,221.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	885,225.95
应支付基金管理人的净管理费	1,020,995.53

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以 1.20% 的管理费率来计算，具体计算方法如下：

每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	238,277.68

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以 0.15% 的托管费年费率来计算，具体计算方法如下：
 每日应计提基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管量化选股股票发起式 A	财通资管量化选股股票发起式 C	合计
财通证券股份有限公司	-	243,899.45	243,899.45
中国工商银行股份有限公司	-	-	-
财通证券资产管理有限公司	-	-	-
合计	-	243,899.45	243,899.45

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%，具体计算方法如下：每日 C 类基金份额应计提的基金销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×年费率÷当年天数。基金销售服务费每日计提。对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额，计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额，持续持有期限未超过一年收取的销售服务费，逐日累计至每月月末，按月支付，持续持有期限超过一年继续计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

财通资管量化选股股票发起式 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2026 年 02 月 05 日）持有的基金份额	10,001,777.85
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,001,777.85
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.07%

注：1. 申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人认购/申购/赎回本基金的交易通过财通证券资产管理有限公司直销办理，适用费率参照《财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金招募说明书》以及 2026 年 02 月 24 日发布的《财通证券资产管理有限公司旗下公募基金在直销渠道开展认（申）购费率优惠活动的公告》的收费标准。

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

本基金本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 02 月 05 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	5,430.86	10,397.71
财通证券股份有限公司	20,040,555.24	2,871.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息，其他存款由基金结算机构财通证券股份有限公司保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 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
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股限售	44.56	468.67	131	5,837.36	61,395.77	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股限售	10.12	27.73	1,745	17,659.40	48,388.85	-

		日								
301669	高特电子	2026 年 06 月 02 日	6 个月	新股限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301531	春光集团	2026 年 04 月 28 日	6 个月	新股限售	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
001365	天海电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	新股限售	27.19	31.31	458	12,453.02	14,339.98	-
301599	理奇智能	2026 年 04 月 22 日	6 个月	新股限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
001393	维通利	2026 年 05 月 08 日	6 个月	新股限售	30.38	38.99	325	9,873.50	12,671.75	-
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

- 1、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中需要限售的部分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。
- 2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。
- 3、基金作为特定投资者，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。
- 4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的的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相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立规范科学有效的内部风险管理体系结构。董事会是公司风险管理的最高决策机构，授权公司经营管理层建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的具体规章制度，组织实施各类风险的识别与评估工作；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，风险管理部负责拟定公司的风险管理政策、风险管理流程和具体制度，并具体实施，确保公司整体风险得到有效的识别、监控和管理，确保公司各项内部管理制度得到有效执行。基金管理业务合规负责人对董事会负责并报告工作，负责监督检查公募基金业务的合法合规性并对内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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 2026 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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。

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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,321,776.67	-	-	-	21,321,776.67
结算备付金	117,294.04	-	-	-	117,294.04
交易性金融资产	-	-	-	283,391,180.68	283,391,180.68
应收申购款	-	-	-	28,801.18	28,801.18

资产总计	21,439,070.71	-	-	283,419,981.86	304,859,052.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,734,696.66	5,734,696.66
应付管理人报酬	-	-	-	308,671.43	308,671.43
应付托管费	-	-	-	38,583.93	38,583.93
应付销售服务费	-	-	-	51,073.77	51,073.77
其他负债	-	-	-	59,414.29	59,414.29
负债总计	-	-	-	6,192,440.08	6,192,440.08
利率敏感度缺口	21,439,070.71	-	-	277,227,541.78	298,666,612.49

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	283,391,180.68	94.89
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	283,391,180.68	94.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“上证综指、中小板指、创业板指”以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026 年 06 月 30 日）
	1. 上证综指、中小板指、创业板指均上升 5%	15,387,480.91
	2. 上证综指、中小板指、创业板指均下降 5%	-15,387,480.91

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日
第一层次	283,194,944.16
第二层次	—
第三层次	196,236.52
合计	283,391,180.68

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。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 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。

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	283,391,180.68	92.96
	其中：股票	283,391,180.68	92.96
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	21,439,070.71	7.03
8	其他各项资产	28,801.18	0.01
9	合计	304,859,052.57	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

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	1,257,481.20	0.42
B	采矿业	2,347,929.00	0.79
C	制造业	225,000,992.12	75.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,481,074.00	0.83
E	建筑业	856,801.00	0.29
F	批发和零售业	6,972,360.00	2.33
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	33,046,790.36	11.06
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	8,091,613.00	2.71
N	水利、环境和公共设施管理业	877,440.00	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,458,700.00	0.82
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	283,391,180.68	94.89

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	300590	移为通信	441,800	6,339,830.00	2.12
2	603025	大豪科技	447,700	6,106,628.00	2.04
3	600884	杉杉股份	450,000	6,097,500.00	2.04
4	600203	福日电子	501,500	6,093,225.00	2.04
5	002558	巨人网络	220,900	6,088,004.00	2.04
6	001218	丽臣实业	258,700	5,706,922.00	1.91
7	603444	吉比特	15,900	5,698,878.00	1.91
8	688111	金山办公	25,500	5,432,775.00	1.82
9	301606	绿联科技	82,600	5,040,252.00	1.69
10	002811	郑中设计	404,600	4,527,474.00	1.52
11	603933	睿能科技	194,700	4,390,485.00	1.47
12	688235	百济神州	16,945	4,314,366.45	1.44
13	000404	长虹华意	547,500	4,303,350.00	1.44
14	300842	帝科股份	47,600	4,244,492.00	1.42
15	002701	奥瑞金	968,200	4,124,532.00	1.38
16	603901	永创智能	377,500	4,103,425.00	1.37
17	603518	锦泓集团	541,300	3,870,295.00	1.30
18	600685	中船防务	150,400	3,826,176.00	1.28
19	002414	高德红外	285,762	3,789,204.12	1.27
20	600356	恒丰纸业	504,500	3,738,345.00	1.25
21	601038	一拖股份	315,054	3,336,421.86	1.12
22	001314	亿道信息	53,200	3,287,760.00	1.10
23	301099	雅创电子	34,050	3,251,775.00	1.09
24	300073	当升科技	63,400	3,045,736.00	1.02
25	688095	福昕软件	51,202	3,042,934.86	1.02
26	301223	中荣股份	187,000	3,014,440.00	1.01
27	002593	日上集团	736,700	2,939,433.00	0.98
28	002054	德美化工	430,600	2,863,490.00	0.96
29	300613	富瀚微	35,400	2,834,832.00	0.95
30	002752	昇兴股份	507,400	2,800,848.00	0.94
31	603739	蔚蓝生物	238,600	2,751,058.00	0.92
32	002998	优彩资源	416,600	2,712,066.00	0.91
33	000951	中国重汽	133,200	2,598,732.00	0.87
34	301536	星宸科技	20,000	2,574,200.00	0.86
35	300458	全志科技	64,700	2,553,062.00	0.85

36	001309	德明利	2,600	2,451,540.00	0.82
37	000553	安道麦 A	454,100	2,429,435.00	0.81
38	603600	永艺股份	269,500	2,390,465.00	0.80
39	603013	亚普股份	150,000	2,368,500.00	0.79
40	000519	中兵红箭	111,300	2,345,091.00	0.79
41	301219	腾远钴业	41,860	2,293,928.00	0.77
42	603190	亚通精工	98,900	2,237,118.00	0.75
43	300531	优博讯	143,400	2,172,510.00	0.73
44	002228	合兴包装	724,800	2,130,912.00	0.71
45	688681	科汇股份	147,582	2,063,196.36	0.69
46	002833	弘亚数控	95,000	1,832,550.00	0.61
47	000938	紫光股份	62,600	1,806,636.00	0.60
48	688266	泽璟制药	15,327	1,788,047.82	0.60
49	688002	睿创微纳	11,449	1,771,045.81	0.59
50	605007	五洲特纸	130,900	1,752,751.00	0.59
51	300358	楚天科技	218,400	1,747,200.00	0.59
52	688819	天能股份	76,780	1,704,516.00	0.57
53	000526	学大教育	67,000	1,700,460.00	0.57
54	002236	大华股份	102,700	1,693,523.00	0.57
55	002284	亚太股份	177,400	1,683,526.00	0.56
56	300012	华测检测	121,000	1,677,060.00	0.56
57	603799	华友钴业	34,500	1,664,970.00	0.56
58	002204	大连重工	314,100	1,658,448.00	0.56
59	600499	科达制造	119,900	1,654,620.00	0.55
60	600761	安徽合力	101,100	1,653,996.00	0.55
61	603198	迎驾贡酒	55,800	1,651,680.00	0.55
62	300871	回盛生物	74,100	1,634,646.00	0.55
63	002479	富春环保	384,400	1,618,324.00	0.54
64	002154	报喜鸟	448,600	1,597,016.00	0.53
65	600546	山煤国际	144,300	1,577,199.00	0.53
66	300042	朗科科技	20,700	1,576,719.00	0.53
67	000589	贵州轮胎	369,800	1,501,388.00	0.50
68	688005	容百科技	48,707	1,490,434.20	0.50
69	603271	永杰新材	33,200	1,475,740.00	0.49
70	002768	国恩股份	28,140	1,464,968.40	0.49
71	688257	新锐股份	14,353	1,462,570.70	0.49
72	002313	日海智能	197,800	1,447,896.00	0.48
73	600150	中国船舶	42,500	1,436,075.00	0.48
74	603317	天味食品	109,300	1,421,993.00	0.48
75	603906	龙蟠科技	53,300	1,414,049.00	0.47
76	002391	长青股份	287,800	1,401,586.00	0.47

77	603383	顶点软件	52,460	1,393,337.60	0.47
78	301292	海科新源	17,100	1,363,383.00	0.46
79	300789	唐源电气	76,500	1,359,405.00	0.46
80	300098	高新兴	287,400	1,319,166.00	0.44
81	300823	建科智能	90,200	1,315,116.00	0.44
82	601233	桐昆股份	60,600	1,311,990.00	0.44
83	002376	新北洋	227,500	1,308,125.00	0.44
84	001368	通达创智	63,300	1,302,081.00	0.44
85	300971	博亚精工	69,600	1,298,736.00	0.43
86	300512	中亚股份	190,200	1,297,164.00	0.43
87	300213	佳讯飞鸿	212,800	1,289,568.00	0.43
88	300371	汇中股份	131,700	1,288,026.00	0.43
89	002748	世龙实业	122,900	1,287,992.00	0.43
90	603059	倍加洁	52,800	1,280,400.00	0.43
91	002722	物产金轮	108,500	1,279,215.00	0.43
92	300414	中光防雷	115,500	1,272,810.00	0.43
93	300865	大宏立	58,100	1,269,485.00	0.43
94	300797	钢研纳克	95,500	1,266,330.00	0.42
95	300970	华绿生物	68,790	1,257,481.20	0.42
96	300975	商络电子	21,800	1,128,150.00	0.38
97	300302	同有科技	22,000	1,125,740.00	0.38
98	605009	豪悦护理	41,500	967,365.00	0.32
99	002079	苏州固锟	61,900	930,357.00	0.31
100	300475	香农芯创	3,100	930,000.00	0.31
101	002602	世纪华通	65,500	923,550.00	0.31
102	002156	通富微电	12,000	910,440.00	0.30
103	603197	保隆科技	32,100	896,874.00	0.30
104	002745	木林森	71,400	896,070.00	0.30
105	300184	力源信息	50,500	886,275.00	0.30
106	601677	明泰铝业	53,300	884,780.00	0.30
107	603588	高能环境	45,700	877,440.00	0.29
108	688699	明微电子	10,682	875,389.90	0.29
109	600380	健康元	92,500	871,350.00	0.29
110	002637	赞宇科技	82,200	865,566.00	0.29
111	000600	建投能源	98,600	862,750.00	0.29
112	003010	若羽臣	35,400	860,220.00	0.29
113	601886	江河集团	106,700	856,801.00	0.29
114	600166	福田汽车	289,900	843,609.00	0.28
115	600741	华域汽车	54,200	841,184.00	0.28
116	603031	安孚科技	15,700	836,025.00	0.28
117	601600	中国铝业	101,000	830,220.00	0.28

118	603986	兆易创新	1,000	815,000.00	0.27
119	002517	恺英网络	49,600	806,000.00	0.27
120	002645	华宏科技	29,200	803,292.00	0.27
121	603661	恒林股份	19,900	796,000.00	0.27
122	002906	华阳集团	31,800	793,728.00	0.27
123	603700	宁水集团	67,900	788,319.00	0.26
124	002035	华帝股份	173,600	784,672.00	0.26
125	603508	思维列控	36,700	783,912.00	0.26
126	603091	众鑫股份	16,020	781,295.40	0.26
127	002296	辉煌科技	87,900	780,552.00	0.26
128	002511	中顺洁柔	117,200	779,380.00	0.26
129	300119	瑞普生物	53,800	776,334.00	0.26
130	601607	上海医药	50,400	776,160.00	0.26
131	301371	敷尔佳	29,700	772,200.00	0.26
132	600971	恒源煤电	111,700	770,730.00	0.26
133	603966	法兰泰克	94,390	769,278.50	0.26
134	603408	建霖家居	79,600	768,140.00	0.26
135	600210	紫江企业	123,100	763,220.00	0.26
136	002997	瑞鹄模具	27,600	760,656.00	0.25
137	605098	行动教育	14,000	758,240.00	0.25
138	603029	天鹅股份	53,800	756,428.00	0.25
139	600519	贵州茅台	600	711,294.00	0.24
140	605117	德业股份	6,600	700,788.00	0.23
141	300694	蠡湖股份	71,200	683,520.00	0.23
142	300445	康斯特	31,800	662,076.00	0.22
143	600570	恒生电子	30,800	652,652.00	0.22
144	002519	银河电子	110,500	646,425.00	0.22
145	300509	新美星	77,071	645,854.98	0.22
146	300490	华自科技	48,100	636,363.00	0.21
147	600626	申达股份	199,200	635,448.00	0.21
148	301665	泰禾股份	30,300	635,088.00	0.21
149	002401	中远海科	54,600	633,906.00	0.21
150	300500	启迪设计	70,300	620,749.00	0.21
151	688797	臻宝科技	131	61,395.77	0.02
152	001399	惠科股份	1,745	48,388.85	0.02
153	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01
154	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
155	001365	天海电子	458	14,339.98	0.00
156	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
157	001393	维通利	325	12,671.75	0.00
158	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00

159	603435	嘉德利	104	4,857.84	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	603025	大豪科技	15,689,164.00	5.25
2	688235	百济神州	11,502,642.97	3.85
3	603444	吉比特	11,436,902.00	3.83
4	688819	天能股份	10,159,189.98	3.40
5	688103	国力电子	9,882,981.82	3.31
6	301606	绿联科技	9,572,316.00	3.21
7	002811	郑中设计	9,496,382.00	3.18
8	300358	楚天科技	9,370,199.00	3.14
9	002558	巨人网络	9,218,694.00	3.09
10	001218	丽臣实业	8,466,147.00	2.83
11	002414	高德红外	8,272,864.42	2.77
12	603901	永创智能	8,129,834.00	2.72
13	603529	爱玛科技	7,885,871.87	2.64
14	002011	盾安环境	7,803,762.00	2.61
15	600884	杉杉股份	7,679,450.00	2.57
16	301536	星宸科技	7,588,861.00	2.54
17	002701	奥瑞金	7,549,583.00	2.53
18	600203	福日电子	7,523,485.00	2.52
19	300590	移为通信	7,474,831.00	2.50
20	002993	奥海科技	7,446,995.20	2.49
21	603218	日月股份	7,431,981.00	2.49
22	300842	帝科股份	7,389,288.00	2.47
23	600469	风神股份	7,375,940.00	2.47
24	600262	北方股份	7,222,598.00	2.42
25	603341	龙旗科技	7,067,396.00	2.37
26	603856	东宏股份	6,961,409.00	2.33
27	300389	艾比森	6,850,267.00	2.29
28	688111	金山办公	6,821,008.65	2.28
29	600380	健康元	6,819,834.00	2.28
30	600196	复星医药	6,794,554.00	2.27
31	688095	福昕软件	6,730,393.25	2.25
32	600479	千金药业	6,726,280.00	2.25

33	002284	亚太股份	6,652,949.00	2.23
34	688708	佳驰科技	6,433,166.41	2.15
35	301099	雅创电子	6,306,291.50	2.11
36	301031	中熔电气	6,222,374.00	2.08
37	002897	意华股份	6,133,014.89	2.05
38	601886	江河集团	5,976,794.00	2.00

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	688103	国力电子	9,507,677.34	3.18
2	603025	大豪科技	8,986,760.00	3.01
3	002993	奥海科技	8,015,635.50	2.68
4	002011	盾安环境	7,729,517.80	2.59
5	688819	天能股份	7,662,018.65	2.57
6	301536	星辰科技	7,558,221.00	2.53
7	603529	爱玛科技	7,474,154.70	2.50
8	600469	风神股份	7,123,046.00	2.38
9	301031	中熔电气	6,998,667.00	2.34
10	688235	百济神州	6,998,627.87	2.34
11	603218	日月股份	6,822,194.00	2.28
12	300358	楚天科技	6,631,231.00	2.22
13	600479	千金药业	6,587,282.00	2.21
14	300389	艾比森	6,563,467.00	2.20
15	600196	复星医药	6,444,984.00	2.16
16	603856	东宏股份	6,418,794.00	2.15
17	002897	意华股份	6,323,526.00	2.12
18	301631	壹连科技	6,169,232.00	2.07
19	603341	龙旗科技	6,145,190.00	2.06
20	688708	佳驰科技	6,097,254.29	2.04
21	600262	北方股份	6,034,555.00	2.02
22	300566	激智科技	6,004,071.50	2.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	1,215,605,075.35
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	898,586,690.36
--------------	----------------

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，同时本着谨慎原则，适度参与股指期货交易。本基金将通过对现货市场和期货市场运行形势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与国债期货交易。本基金将结合国债

交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，巨人网络集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会重庆监管局的处罚。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下：本基金管理人对证券投资有严格的投资决策流程控制，本基金对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上，本基金严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中，研究员密切关注证券发行主体动向，在上述处罚发生时及时分析其对该投资决策的影响。经过分析认为此事件对该证券发行主体的财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响，因此不影响对该证券基本面和投资价值的判断。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

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	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	28,801.18
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	28,801.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
财通资管 量化选股 股票发起 式 A	932	180,878.57	44,799,252.47	26.57%	123,779,572.83	73.43%
财通资管 量化选股 股票发起 式 C	1,455	108,194.39	6,441,829.34	4.09%	150,981,011.40	95.91%
合计	2,387	136,573.80	51,241,081.81	15.72%	274,760,584.23	84.28%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	财通资管量化 选股股票发起	3,325,403.55	1.97%

	式 A		
	财通资管量化 选股股票发起 式 C	309,014.85	0.20%
	合计	3,634,418.40	1.11%

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	财通资管量化选股股票发起式 A	>100
	财通资管量化选股股票发起式 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	财通资管量化选股股票发起式 A	>100
	财通资管量化选股股票发起式 C	0
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,777.85	3.07%	10,001,777.85	3.07%	自基金合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	437,413.03	0.13%	—	—	—
基金经理等人员	1,230,011.12	0.38%	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	11,669,202.00	3.58%	10,001,777.85	3.07%	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	财通资管量化选股股票发起式 A	财通资管量化选股股票发起式 C
基金合同生效日（2026 年 02 月 05 日）基金份额总额	240,285,327.67	244,867,932.71
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,286,445.55	28,531,304.08

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	83,992,947.92	115,976,396.05
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	168,578,825.30	157,422,840.74

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 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

1、报告期内，经本基金管理人第三届董事会第二十四、二十五次会议审议通过并按规定备案，自 2026 年 1 月 1 日起邹广航先生担任副总经理兼财务负责人。

2、报告期内，无基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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、基金财产的诉讼。本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无因基金业务受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无因基金业务受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	4	1,320,552,431.48	62.47%	582,074.03	62.41%	-
金融街证券	3	793,290,474.60	37.53%	350,523.55	37.59%	本报告期新增

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	80,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：公司在综合考虑证券公司内控情况和服务能力等多因素下，选择财务状况良好、经营行为规范、具有较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力的证券公司参与证券交易。

a. 选择证券公司参与证券交易的标准如下：

1、经营行为规范、财务状况良好；

- 2、具有较强的合规风控能力，内控制度健全，风险管理机制完善；
 - 3、具备较强的交易服务能力，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，具备成熟、稳定的交易系统；
 - 4、具备较强的研究服务能力，包括但不限于较完整的研究团队配置、较好的研究和行业分析能力、良好的研究服务质量及提供定制化研究服务的能力等。
- b. 选择证券公司参与证券交易的程序如下：
- 1、对证券公司的经营情况、财务状况、合规风控能力、交易、研究服务能力等进行初步调查；
 - 2、对于符合公司标准的证券公司，与其沟通证券经纪服务协议，约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式；
 - 3、经审批后完成相关协议签订，并根据签署协议情况完成信息录入、开户、系统参数设置等；
 - 4、研究服务评价每季度进行一次，评价结果作为季度佣金分配依据。
- c. 上述交易单元均为本报告期新增。

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	财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金产品资料概要	上海证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年01月19日
2	财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金招募说明书	上海证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年01月19日
3	财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同	上海证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年01月19日
4	财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金托管协议	上海证券报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2026年01月19日
5	财通资管量化选股股票型发起式证券投	上海证券报、管理人网站	2026年01月19日

	资基金风险揭示书	(www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	
6	财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	2026年01月19日
7	财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	2026年01月19日
8	关于财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	上海证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	2026年01月29日
9	财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金合同生效公告	上海证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	2026年02月06日
10	财通资管量化选股股票发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	上海证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	2026年02月13日
11	关于财通证券资产管理有限公司旗下公募基金在直销渠道开展认（申）购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	2026年02月24日
12	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在财通证券股份有限公司新增转换业务的公告	上海证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	2026年03月02日
13	财通证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	上海证券报、管理人网站 (www.ctzg.com)和中国证监会基金电子披露网站 (http://eid.csrc.gov.cn/fund)	2026年03月30日

14	财通证券资产管理有限公司年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	上海证券报、管理人网站（ www.ctzg.com ）和中国证监会基金电子披露网站（ http://eid.csrc.gov.cn/fund ）	2026年04月28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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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

- 1、财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金托管协议
- 4、财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同
- 5、财通资管量化选股股票型发起式证券投资基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路 26 弄富汇大厦 B 座 8、9 层

浙江省杭州市上城区新业路 300 号中国人寿大厦 2 幢 22 层

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：400-116-7888

公司网址: www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司

2026 年 08 月 31 日