

财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 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28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01月01日起至2026年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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
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.....	12
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.....	13
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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	43
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.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58

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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 盈利投资者数量占比	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
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	63
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金(L OF)	
基金简称	财通福瑞混合发起（LOF）	
场内简称	财通福瑞混合LOF	
基金主代码	501028	
交易代码	501028	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年12月29日	
基金管理人	财通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	146,177,896.99份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017年02月20日	
下属分级基金的基金简称	财通福瑞混合发起（L OF）A	财通福瑞混合发起（L OF）C
下属分级基金场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	501028	014627
报告期末下属分级基金的份额总额	40,366,121.16份	105,811,775.83份

注：(1)自2018年12月29日起，“财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金”的基金名称变更为“财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）”，并正式实施基金转型；

(2)本基金自2021年12月22日起增加收取销售服务费的C类基金份额，原基金份额变更为A类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
------	---

投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券类资产投资策略、权证投资策略、股指期货的投资策略、资产支持证券投资策略。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。	
下属分级基金的风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。

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		财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	郭明
	联系电话	021-20537888	(010) 66105799
	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-9888	95588
传真		021-68888169/021-68888661	(010) 66105798
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		吴林惠	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ctfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	财通福瑞混合发起 (LOF) A	财通福瑞混合发起 (LOF) C
本期已实现收益	2,926,769.31	5,648,920.49
本期利润	-1,146,274.60	-2,476,417.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0321	-0.0234
本期加权平均净值利润率	-2.18%	-2.41%
本期基金份额净值增长率	-2.32%	-2.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	16,371,552.22	-8,175,237.64
期末可供分配基金份额利润	0.4056	-0.0773
期末基金资产净值	56,737,673.38	97,636,538.19
期末基金份额净值	1.4056	0.9227

3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	91.94%	-7.73%

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）。

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

财通福瑞混合发起（LOF）A

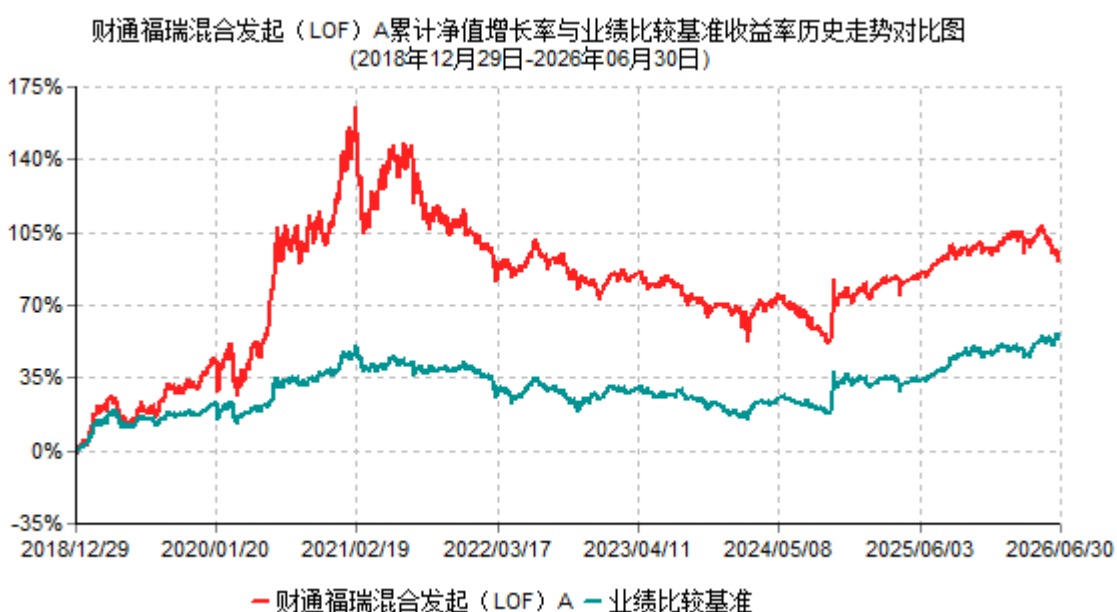
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-4.43%	0.62%	6.98%	0.69%	-11.41%	-0.07%
过去六个月	-2.32%	0.67%	5.04%	0.62%	-7.36%	0.05%
过去一年	2.64%	0.59%	14.78%	0.56%	-12.14%	0.03%
过去三年	4.64%	0.78%	23.05%	0.61%	-18.41%	0.17%
过去五年	-21.96%	0.84%	8.65%	0.61%	-30.61%	0.23%
过去七年	59.00%	1.10%	34.74%	0.64%	24.26%	0.46%
自基金合同 生效起至今	91.94%	1.10%	55.66%	0.65%	36.28%	0.45%

财通福瑞混合发起（LOF）C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-4.50%	0.62%	6.98%	0.69%	-11.48%	-0.07%

过去六个月	-2.47%	0.68%	5.04%	0.62%	-7.51%	0.06%
过去一年	2.33%	0.59%	14.78%	0.56%	-12.45%	0.03%
过去三年	3.70%	0.78%	23.05%	0.61%	-19.35%	0.17%
自增加C类 基金份额起 至今	-7.73%	0.75%	11.05%	0.61%	-18.78%	0.14%

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





注：(1)本基金转型日为2018年12月29日；

(2)本基金建仓期为自基金合同生效起6个月内，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定；

(3)本基金自2021年12月22日起增加C类基金份额，相关数据按实际存续期计算。

§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

财通基金管理有限公司（下称“财通基金”）经中国证监会批准，于2011年6月正式成立。目前公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、QDII、受托管理保险资金投资管理等业务资格。公司股东为财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江亨通控股股份有限公司，注册资本2亿元人民币，注册地上海。成立15年来，公司收获了“三大报”权威奖项（金牛奖+金基金奖+明星基金奖），先后荣获167项业内权威大奖。

截至2026年6月末，财通基金合计管理规模约2,172.25亿元，其中，公募基金管理规模约1,670.83亿元。公司以打造“特色鲜明、多元发展、客户信赖”的一流资产管理公司为企业愿景，坚持多元化业务布局，旗下公募基金覆盖股票、混合、债券、指数、货币等完整产品线，可满足不同类型客户的多元化需求。同时公司在专户业务中勇于突破，不断探索定增+、固收+、量化+等特色领域，努力以专业创造价值。

财通基金始终恪守“敬畏、感恩、专业、责任”的核心价值观，坚信投研是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为本源，坚守初心、苦练内功，配备了一支资深投研专家团队，纵深一级半、二级市场，持续为投资者创造价值。

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		
顾弘原	本基金的基金经理	2023-04-11	-	9年	伦敦政治经济学院统计学硕士。历任香港伟享证券有限公司分析师。2017年2月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部助理研究员、研究员，现任量化投资部基金经理。

注：(1)首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理的“任职日期”和“离任日期”分别为根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和本基金合同，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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投资组合，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。本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现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。本报告期内，未发现本基金存在可能导致利益输送的异常交易行为。

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

本基金持续聚焦中长期有投资价值的优质公司，投资策略上力求通过多种策略的动态调整，着力构建长期业绩可视度高、短期成长性得到验证、具有高性价比的投资组合。在持股风格上，阶段性会有价值风格的暴露，在持股周期上，以中周期低换手为主，阶段性可能会有以应对短期风格切换为目的的小范围波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，财通福瑞混合发起（LOF）A基金份额净值为1.4056元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.32%，同期业绩比较基准收益率为5.04%；截至本报告期末，财通福瑞混合发起（LOF）C基金份额净值为0.9227元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.47%，同期业绩比较基准收益率为5.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2026年上半年，国内经济整体延续修复态势，经济韧性进一步增强。随着一揽子稳增长政策持续落地以及“反内卷”政策逐步向供给端传导，制造业持续维持较为景气状态。6月份官方制造业PMI回升至50.3，维持在扩张区间，新订单和生产指数同步改善，高技术制造业景气度维持高位，显示经济内生动能的持续恢复。与此同时，AI产业链、先进制造等领域资本开支持续扩张，叠加价格水平的稳步抬升态势，为未来企业盈利持续改善提供了支撑。不过，地产投资和居民消费修复仍相对温和，经济复苏依然呈现结构性特征。

海外方面，美国经济整体表现仍具韧性，就业市场和制造业景气维持扩张，市场对未来联储降息的预期也因此出现收敛。除此之外，我们认为二季度最大的宏观变量来自中东地缘局势，美伊及中东冲突一度引发国际油价快速上涨，市场担忧霍尔木兹海峡运输受阻，全球通胀预期明显抬升；但随着局势阶段性缓和，油价风险溢价快速回落，全

球风险偏好重新修复。整体来看，海外市场对于地缘政治的敏感度有所下降，但未来货币政策仍高度依赖通胀及就业数据，全球宏观环境依然存在较高的不确定性。

对应到资本市场，A股整体延续震荡上行格局，市场风格分化进一步加剧。随着AI基础设施投资持续超预期，全球科技龙头资本开支维持高增长，AI产业链景气度不断强化，细分硬科技方向持续获得产业催化与盈利预期上修，成为市场主要的超额收益来源之一。与此同时，“反内卷”政策推动部分传统制造行业供需格局改善，资源品及部分周期行业也获得阶段性修复。尽管市场多次受到海外利率预期及地缘冲突扰动，整体波动率明显提升，但产业趋势逐渐成为市场定价的核心逻辑。

展望下半年，国内经济预计仍将呈现“总量温和修复、结构分化延续”的特征。海外方面，经济韧性意味着美联储降息节奏可能继续受到通胀和就业数据约束，地缘冲突及能源价格波动或是全球风险偏好的主要扰动。对应到资本市场，下半年A股或延续震荡中枢抬升但结构高度分化的格局，虽然AI产业链的核心叙事尚未结束，但市场对目前叙事定价已经相对充分，因而下半年行情可能也会更加均衡。市场定价将进一步从主题驱动转向盈利验证，而盈利改善是否能够从上游向中下游扩散，我们认为将成为下半年行情由结构性机会走向更广泛修复的关键条件。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的相关规定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会负责根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确定调整/暂停估值方案，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。估值委员会配备投资、研究、会计、风控等岗位资深人员，成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。估值方法/价格调整需经估值委员会决议通过，并征询基金托管人同意后才能采纳。

基金日常估值由本基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

根据相关法律法规及《基金合同》的要求，结合本基金运作情况，本报告期内本基金未进行过利润分配。

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，本基金未有连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——财通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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基金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：财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）

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	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	48,270,429.20	10,061,122.78
结算备付金		466,278.42	579,767.28

存出保证金		1,480.35	6,273.03
交易性金融资产	6.4.7.2	106,184,445.62	142,885,511.26
其中：股票投资		106,184,445.62	110,063,620.19
基金投资		-	-
债券投资		-	32,821,891.07
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		12,868.71	984.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		154,935,502.30	153,533,659.24
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		209,947.17	-
应付管理人报酬		74,696.13	78,821.16
应付托管费		18,674.03	19,705.32
应付销售服务费		24,583.83	25,553.60
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	233,389.57	207,075.16
负债合计		561,290.73	331,155.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	146,177,896.99	142,683,132.60
未分配利润	6.4.7.8	8,196,314.58	10,519,371.40
净资产合计		154,374,211.57	153,202,504.00
负债和净资产总计		154,935,502.30	153,533,659.24

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额146,177,896.99份。其中A类基金的份额净值1.4056元，份额总额40,366,121.16份；C类基金的份额净值0.9227元，份额总额105,811,775.83份。

6.2 利润表

会计主体：财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		-2,823,665.94	7,795,940.77
1.利息收入		63,529.14	69,735.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	63,529.14	68,183.77
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		-	1,551.37
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,288,674.02	9,890,209.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,279,368.71	8,424,787.34

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	74,069.10	200,179.39
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	935,236.21	1,265,243.21
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	-12,198,382.28	-2,180,714.94
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	22,513.18	16,710.63
减：二、营业总支出		799,026.54	790,093.86
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	461,780.73	464,757.15
2.托管费	6.4.10.2.2	115,445.20	116,189.37
3.销售服务费	6.4.10.2.3	152,620.05	137,739.22
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	69,180.56	71,408.12
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-3,622,692.48	7,005,846.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-3,622,692.48	7,005,846.91
五、其他综合收益的税后 净额		-	-

六、综合收益总额		-3,622,692.48	7,005,846.91
----------	--	---------------	--------------

6.3 净资产变动表

会计主体：财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01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	142,683,132.60	10,519,371.40	153,202,504.00
二、本期期初净资产	142,683,132.60	10,519,371.40	153,202,504.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,494,764.39	-2,323,056.82	1,171,707.57
（一）、综合收益总额	-	-3,622,692.48	-3,622,692.48
（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）	3,494,764.39	1,299,635.66	4,794,400.05
其中：1.基金申购款	7,311,671.74	3,032,028.54	10,343,700.28
2.基金赎回款	-3,816,907.35	-1,732,392.88	-5,549,300.23
（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	146,177,896.99	8,196,314.58	154,374,211.57

项 目	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025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	154,517,030.73	557,780.85	155,074,811.58
二、本期期初净资产	154,517,030.73	557,780.85	155,074,811.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,700,401.42	6,459,229.79	4,758,828.37
（一）、综合收益总额	-	7,005,846.91	7,005,846.91
（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）	-1,700,401.42	-546,617.12	-2,247,018.54
其中：1.基金申购款	2,685,500.08	952,737.51	3,638,237.59
2.基金赎回款	-4,385,901.50	-1,499,354.63	-5,885,256.13
（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	152,816,629.31	7,017,010.64	159,833,639.95

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：

徐春庭

刘为臻

孙金

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

财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）由财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金转型而成，财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金系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[2016]2009号文《关于准予财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2016年11月22日生效，首次设立募集规模为3,082,380,658.22份基金份额。根据《财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》及《财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自2018年12月29日起转型为上市开放式基金（LOF）并更名为财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为财通基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金管理人财通基金管理有限公司于2021年12月21日发布的《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加C类基金份额并相应修改法律文件的公告》，自2021年12月22日起，本基金增加收取销售服务费的C类基金，并对本基金的基金合同作相应修改。本基金原基金份额全部归入A类份额。

本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，分别设置代码、分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。在投资者申购时收取申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费且不从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资者申购时不收取申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费且从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额，称为C类基金份额。

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板、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、债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产比例为基金资产的50%~95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《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》《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

本基金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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况、自2026年01月01日起至2026年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股

息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的资管产品运营业务，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)2027年12月31日前，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税。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。

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(4)对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。

(5)对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(6)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	48,270,429.20
等于：本金	48,266,346.56
加：应计利息	4,082.64
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	48,270,429.20

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		116,338,572.09	-	106,184,445.62	-10,154,126.47
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	116,338,572.09	-	106,184,445.62	-10,154,126.47

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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买断式逆回购交易中取得的债券。

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	1.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	44,302.79
其中：交易所市场	44,302.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	189,085.56
合计	233,389.57

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 财通福瑞混合发起（LOF）A

金额单位：人民币元

项目 (财通福瑞混合发起(LOF)A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,940,293.44	36,940,293.44
本期申购	7,089,448.67	7,089,448.67
本期赎回（以“-”号填列）	-3,663,620.95	-3,663,620.95
本期末	40,366,121.16	40,366,121.16

6.4.7.7.2 财通福瑞混合发起（LOF）C

金额单位：人民币元

项目 (财通福瑞混合发起(LOF)C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	105,742,839.16	105,742,839.16
本期申购	222,223.07	222,223.07
本期赎回（以“-”号填列）	-153,286.40	-153,286.40
本期末	105,811,775.83	105,811,775.83

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 财通福瑞混合发起（LOF）A

单位：人民币元

项目 (财通福瑞混合发起(LOF)A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,563,525.17	-12,345,546.51	16,217,978.66
本期期初	28,563,525.17	-12,345,546.51	16,217,978.66
本期利润	2,926,769.31	-4,073,043.91	-1,146,274.60
本期基金份额交易产生的变动数	3,091,372.53	-1,791,524.37	1,299,848.16
其中：基金申购款	6,045,841.98	-3,007,776.03	3,038,065.95

基金赎回款	-2,954,469.45	1,216,251.66	-1,738,217.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,581,667.01	-18,210,114.79	16,371,552.22

6.4.7.8.2 财通福瑞混合发起（LOF）C

单位：人民币元

项目 (财通福瑞混合发起(L OF) C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,968,973.06	-729,634.20	-5,698,607.26
本期期初	-4,968,973.06	-729,634.20	-5,698,607.26
本期利润	5,648,920.49	-8,125,338.37	-2,476,417.88
本期基金份额交易产 生的变动数	-4,410.03	4,197.53	-212.50
其中：基金申购款	-8,878.35	2,840.94	-6,037.41
基金赎回款	4,468.32	1,356.59	5,824.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	675,537.40	-8,850,775.04	-8,175,237.64

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	63,134.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	383.47
其他	11.50
合计	63,529.14

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01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	51,387,560.95
减：卖出股票成本总额	43,031,333.89
减：交易费用	76,858.35
买卖股票差价收入	8,279,368.71

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	47,998.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	26,070.17
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	74,069.10

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	32,854,690.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	32,373,929.83
减：应计利息总额	454,690.00
减：交易费用	-

买卖债券差价收入	26,070.17
----------	-----------

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

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01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	935,236.21
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	935,236.21

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01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-12,198,382.28
——股票投资	-12,157,112.11
——债券投资	-41,270.17
——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	-12,198,382.28

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	22,513.18
合计	22,513.18

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	9,578.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	95.00
合计	69,180.56

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内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
财通基金管理有限公司(“财通基金”)	基金管理人、基金发起人、基金销售机构
财通证券股份有限公司(“财通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年01月01日至2026年06月30日	2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	461,780.73	464,757.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	56,001.53	66,796.27
应支付基金管理人的净管理费	405,779.20	397,960.88

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	115,445.20	116,189.37

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通福瑞混合发起（LOF）A	财通福瑞混合发起（LOF）C	合计
财通基金	0.00	152,393.77	152,393.77
工商银行	0.00	184.03	184.03
合计	0.00	152,577.80	152,577.80
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

名称	财通福瑞混合发起（LOF）A	财通福瑞混合发起（LOF）C	合计
财通基金	0.00	137,734.28	137,734.28
合计	0.00	137,734.28	137,734.28

注：(1)本基金A类基金份额不收取销售服务费；
(2)本基金C类基金份额销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值的0.30%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；
(3)本基金C类基金份额销售服务费的计算公式为：每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.30%/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

本基金本报告期及上年度可比期间均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
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

财通福瑞混合发起（LOF）A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

财通福瑞混合发起（LOF）C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	20,451,797.93	20,451,797.93
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	20,451,797.93	20,451,797.93
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.33%	19.35%

注：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。

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

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	48,270,429.20	63,134.17	23,493,090.10	26,474.55

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

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
688802	沐曦股份	2025-12-09	6个月以上	新股限售	104.66	768.89	400	41,864.00	307,556.00	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股限售	81.88	1,584.33	38	3,111.44	60,204.54	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月以上	新股限售	22.68	42.16	1,358	30,799.44	57,253.28	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	新股限售	9.47	70.14	445	4,214.15	31,212.30	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	新股限售	44.56	468.67	50	2,228.00	23,433.50	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股限售	17.52	35.92	625	10,950.00	22,450.00	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股限售	40.98	308.19	67	2,745.66	20,648.73	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股限售	26.28	172.09	111	2,917.08	19,101.99	-

688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股限售	92.18	463.15	36	3,318.48	16,673.40	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股限售	6.41	24.13	474	3,038.34	11,437.62	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股限售	17.70	84.32	93	1,646.10	7,841.76	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股限售	15.76	46.71	73	1,150.48	3,409.83	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股限售	11.18	17.59	132	1,475.76	2,321.88	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股限售	21.88	25.52	41	897.08	1,046.32	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股限售	37.88	34.87	29	1,098.52	1,011.23	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股限售	33.49	33.93	28	937.72	950.04	-

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

于2026年06月30日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2026年06月30日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。公司经营管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，经营管理层下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的法律合规部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

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建立了信用风险管理流程，通过对各类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，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人工商银行，按银行同业利率计息，与该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、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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，并对基金组合资产中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超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	48,270,429.20	-	-	-	-	-	48,270,429.20
结算备付金	466,278.42	-	-	-	-	-	466,278.42
存出保证金	1,480.35	-	-	-	-	-	1,480.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	106,184,445.62	106,184,445.62
应收申购款	-	-	-	-	-	12,868.71	12,868.71
资产总计	48,738,187.97	-	-	-	-	106,197,314.33	154,935,502.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	209,947.17	209,947.17

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	74,696.13	74,696.13
应付托管费	-	-	-	-	-	18,674.03	18,674.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24,583.83	24,583.83
其他负债	-	-	-	-	-	233,389.57	233,389.57
负债总计	-	-	-	-	-	561,290.73	561,290.73
利率敏感度缺口	48,738,187.97	-	-	-	-	105,636,023.60	154,374,211.57
上年度末2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	10,061,122.78	-	-	-	-	-	10,061,122.78
结算备付金	579,767.28	-	-	-	-	-	579,767.28
存出保证	6,273.03	-	-	-	-	-	6,273.03

金							
交易性金融资产	23,155,451.07	9,666,440.00	-	-	-	110,063,620.19	142,885,511.26
应收申购款	-	-	-	-	-	984.89	984.89
资产总计	33,802,614.16	9,666,440.00	-	-	-	110,064,605.08	153,533,659.24
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	78,821.16	78,821.16
应付托管费	-	-	-	-	-	19,705.32	19,705.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	25,553.60	25,553.60
其他负债	-	-	-	-	-	207,075.16	207,075.16
负债总计	-	-	-	-	-	331,155.24	331,155.24
利率敏感度缺口	33,802,614.16	9,666,440.00	-	-	-	109,733,449.84	153,202,504.00

注：表中所示为本基金资产负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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	上年度末 2025年12月31日
	市场利率下降25个基点	-	7,193.17
	市场利率上升25个基点	-	-7,193.17

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

其他价格风险主要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证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，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（含存托凭证）资产比例为基金资产的50%~95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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。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		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	106,184,445.62	68.78	110,063,620.19	71.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	32,821,891.07	21.42
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	106,184,445.62	68.78	142,885,511.26	93.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
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	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准增加1%	1,147,583.12	1,438,492.36
	业绩比较基准减少1%	-1,147,583.12	-1,438,492.36

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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	上年度末 2025年12月31日
第一层次	105,597,893.20	109,764,160.11
第二层次	-	32,899,866.82
第三层次	586,552.42	221,484.33
合计	106,184,445.62	142,885,511.26

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股票、债券等投资，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，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025年12月31日：无)。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2026年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	106,184,445.62	68.53
	其中：股票	106,184,445.62	68.53
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	48,736,707.62	31.46
8	其他各项资产	14,349.06	0.01
9	合计	154,935,502.30	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	895,384.00	0.58
B	采矿业	2,303,063.00	1.49
C	制造业	49,645,761.13	32.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,362,889.00	8.01
E	建筑业	2,514,102.00	1.63
F	批发和零售业	1,369,668.78	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	16,041,550.00	10.39
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,711,389.69	3.70
J	金融业	7,940,681.66	5.14
K	房地产业	2,067,596.00	1.34
L	租赁和商务服务业	855,935.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	1,368,007.36	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	1,126,621.00	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	778,757.00	0.50
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,203,040.00	0.78
S	综合	-	-
	合计	106,184,445.62	68.78

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通过港股通机制投资的港股。

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	1,500	1,905,000.00	1.23
2	600999	招商证券	87,700	1,850,470.00	1.20
3	002463	沪电股份	11,200	1,711,360.00	1.11
4	001389	广合科技	7,000	1,660,750.00	1.08
5	000429	粤高速A	109,800	1,498,770.00	0.97
6	300857	协创数据	4,400	1,495,560.00	0.97
7	601985	中国核电	153,600	1,387,008.00	0.90
8	300894	火星人	109,900	1,380,344.00	0.89
9	600177	雅戈尔	179,496	1,351,604.88	0.88
10	600886	国投电力	101,200	1,346,972.00	0.87
11	001965	招商公路	146,800	1,344,688.00	0.87

12	600900	长江电力	50,500	1,336,735.00	0.87
13	000685	中山公用	117,900	1,315,764.00	0.85
14	000333	美的集团	17,300	1,306,669.00	0.85
15	600690	海尔智家	63,913	1,304,464.33	0.85
16	600018	上港集团	276,000	1,302,720.00	0.84
17	601319	中国人保	192,200	1,299,272.00	0.84
18	600377	宁沪高速	112,100	1,296,997.00	0.84
19	000623	吉林敖东	73,100	1,296,063.00	0.84
20	603259	药明康德	10,400	1,294,904.00	0.84
21	000651	格力电器	34,500	1,293,750.00	0.84
22	002736	国信证券	128,700	1,285,713.00	0.83
23	000598	兴蓉环境	200,000	1,284,000.00	0.83
24	600674	川投能源	90,400	1,280,968.00	0.83
25	688009	中国通号	268,941	1,280,159.16	0.83
26	600352	浙江龙盛	105,200	1,273,972.00	0.83
27	601298	青岛港	156,200	1,257,410.00	0.81
28	000088	盐田港	304,600	1,245,814.00	0.81
29	601326	秦港股份	394,200	1,245,672.00	0.81
30	601607	上海医药	80,700	1,242,780.00	0.81
31	601000	唐山港	296,900	1,232,135.00	0.80
32	000538	云南白药	26,000	1,231,620.00	0.80
33	600008	首创环保	450,900	1,226,448.00	0.79
34	600064	南京高科	171,800	1,224,934.00	0.79
35	600033	福建高速	379,200	1,221,024.00	0.79
36	600332	白云山	60,900	1,220,436.00	0.79
37	601668	中国建筑	281,000	1,219,540.00	0.79
38	600820	隧道股份	232,300	1,210,283.00	0.78
39	600887	伊利股份	50,500	1,209,980.00	0.78
40	600572	康恩贝	308,000	1,207,360.00	0.78
41	601006	大秦铁路	261,800	1,206,898.00	0.78
42	601766	中国中车	231,100	1,201,720.00	0.78

43	603119	浙江荣泰	18,070	1,198,763.80	0.78
44	601098	中南传媒	121,300	1,193,592.00	0.77
45	003816	中国广核	301,400	1,178,474.00	0.76
46	601018	宁波港	373,200	1,175,580.00	0.76
47	000563	陕国投A	423,300	1,168,308.00	0.76
48	600017	日照港	466,139	1,165,347.50	0.75
49	600901	江苏金租	200,300	1,151,725.00	0.75
50	600028	中国石化	256,200	1,142,652.00	0.74
51	002267	陕天然气	174,000	1,137,960.00	0.74
52	601088	中国神华	28,900	1,128,256.00	0.73
53	601330	绿色动力	161,000	1,122,170.00	0.73
54	000895	双汇发展	50,000	1,120,000.00	0.73
55	601318	中国平安	23,400	1,117,116.00	0.72
56	688030	山石网科	69,400	1,095,826.00	0.71
57	688670	金迪克	64,200	1,087,548.00	0.70
58	301571	国科天成	16,500	1,075,470.00	0.70
59	603313	梦百合	179,100	1,060,272.00	0.69
60	601952	苏垦农发	138,500	1,037,365.00	0.67
61	600405	动力源	219,400	991,688.00	0.64
62	688111	金山办公	4,510	960,855.50	0.62
63	600439	瑞贝卡	438,900	926,079.00	0.60
64	300513	恒实科技	126,600	916,584.00	0.59
65	603208	江山欧派	84,100	899,870.00	0.58
66	688215	瑞晟智能	22,330	896,772.80	0.58
67	688152	麒麟信安	32,600	895,848.00	0.58
68	600598	北大荒	82,600	895,384.00	0.58
69	600831	广电网络	297,900	890,721.00	0.58
70	002614	奥佳华	199,600	882,232.00	0.57
71	000910	大亚圣象	169,300	868,509.00	0.56
72	002855	捷荣技术	91,400	868,300.00	0.56
73	002743	富煌钢构	224,100	865,026.00	0.56

74	002224	三力士	263,100	860,337.00	0.56
75	603192	汇得科技	50,600	857,164.00	0.56
76	000880	潍柴重机	37,200	855,972.00	0.55
77	000605	渤海股份	159,700	854,395.00	0.55
78	000607	华媒控股	277,700	852,539.00	0.55
79	603180	金牌家居	62,000	850,640.00	0.55
80	300512	中亚股份	123,700	843,634.00	0.55
81	600533	栖霞建设	445,700	842,373.00	0.55
82	688793	倍轻松	52,200	840,942.00	0.54
83	688808	联讯仪器	371	833,540.43	0.54
84	603385	惠达卫浴	170,100	830,088.00	0.54
85	603117	万林物流	245,700	823,095.00	0.53
86	301011	华立科技	57,700	815,878.00	0.53
87	688060	云涌科技	24,100	792,649.00	0.51
88	600661	昂立教育	112,700	778,757.00	0.50
89	688089	嘉必优	71,800	761,798.00	0.49
90	600844	金煤科技	308,500	746,570.00	0.48
91	688802	沐曦股份	614	484,812.20	0.31
92	688797	臻宝科技	493	329,152.23	0.21
93	688635	长进光子	665	292,439.73	0.19
94	688807	优迅股份	616	247,896.88	0.16
95	688012	中微公司	395	185,057.50	0.12
96	688785	恒运昌	359	173,015.09	0.11
97	688781	视涯科技	2,088	94,505.18	0.06
98	688545	兴福电子	680	90,480.80	0.06
99	300475	香农芯创	300	90,000.00	0.06
100	688411	海博思创	284	82,700.80	0.05
101	603929	亚翔集成	300	81,606.00	0.05
102	002281	光迅科技	300	77,082.00	0.05
103	603129	春风动力	300	76,740.00	0.05
104	688409	富创精密	200	61,250.00	0.04

105	688605	先锋精科	584	60,747.68	0.04
106	688692	达梦数据	243	59,362.47	0.04
107	688020	方邦股份	200	49,920.00	0.03
108	300570	太辰光	200	49,342.00	0.03
109	603435	嘉德利	722	47,710.57	0.03
110	688583	思看科技	479	41,083.83	0.03
111	688188	柏楚电子	353	37,665.10	0.02
112	688757	胜科纳米	536	35,751.20	0.02
113	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.02
114	688002	睿创微纳	219	33,877.11	0.02
115	300408	三环集团	200	33,380.00	0.02
116	605499	东鹏饮料	260	32,091.80	0.02
117	688712	北芯生命	882	32,030.96	0.02
118	688596	正帆科技	399	31,544.94	0.02
119	688818	电科蓝天	445	31,212.30	0.02
120	688170	德龙激光	304	29,187.04	0.02
121	688508	芯朋微	297	27,609.12	0.02
122	688809	强一股份	43	26,789.00	0.02
123	002938	鹏鼎控股	200	21,076.00	0.01
124	603092	德力佳	383	20,670.51	0.01
125	688811	有研复材	732	19,435.62	0.01
126	688813	泰金新能	111	19,101.99	0.01
127	603257	中国瑞林	224	17,469.76	0.01
128	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.01
129	603418	友升股份	377	16,652.09	0.01
130	688796	百奥赛图	141	15,425.40	0.01
131	002353	杰瑞股份	100	15,250.00	0.01
132	688755	汉邦科技	550	15,158.00	0.01
133	603699	纽威股份	300	15,090.00	0.01
134	688112	鼎阳科技	200	14,692.00	0.01
135	002475	立讯精密	200	14,080.00	0.01

136	601126	四方股份	200	12,640.00	0.01
137	603014	威高血净	386	12,633.78	0.01
138	000893	亚钾国际	300	12,267.00	0.01
139	605020	永和股份	300	12,216.00	0.01
140	688795	摩尔线程	17	12,180.33	0.01
141	603202	天有为	244	11,990.16	0.01
142	300677	英科医疗	300	11,751.00	0.01
143	002422	科伦药业	300	11,556.00	0.01
144	603293	埃泰克	279	11,271.16	0.01
145	688208	道通科技	434	10,932.46	0.01
146	600036	招商银行	300	10,650.00	0.01
147	603352	至信股份	409	10,625.36	0.01
148	688088	虹软科技	290	10,309.50	0.01
149	603284	林平发展	290	10,297.61	0.01
150	300628	亿联网络	300	10,146.00	0.01
151	688435	英方软件	300	9,600.00	0.01
152	601112	振石股份	520	9,395.12	0.01
153	002352	顺丰控股	300	9,378.00	0.01
154	603409	汇通控股	475	8,716.25	0.01
155	603976	正川股份	300	8,637.00	0.01
156	603338	浙江鼎力	200	8,500.00	0.01
157	688805	健信超导	178	8,360.66	0.01
158	002245	蔚蓝锂芯	444	8,307.24	0.01
159	600938	中国海油	300	8,145.00	0.01
160	301029	怡合达	300	8,103.00	0.01
161	002594	比亚迪	100	7,970.00	0.01
162	002032	苏泊尔	200	7,920.00	0.01
163	600988	赤峰黄金	300	7,896.00	0.01
164	300777	中简科技	300	7,884.00	0.01
165	688129	东来技术	300	7,857.00	0.01
166	603459	红板科技	93	7,841.76	0.01

167	600685	中船防务	300	7,632.00	0.00
168	603376	大明电子	306	7,582.68	0.00
169	603370	华新精科	200	7,196.00	0.00
170	002202	金风科技	300	7,170.00	0.00
171	300724	捷佳伟创	100	7,060.00	0.00
172	603406	天富龙	266	6,902.70	0.00
173	600096	云天化	200	6,080.00	0.00
174	603334	丰倍生物	169	6,004.57	0.00
175	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.00
176	688357	建龙微纳	200	5,894.00	0.00
177	002683	广东宏大	200	5,858.00	0.00
178	601601	中国太保	200	5,704.00	0.00
179	601689	拓普集团	100	5,642.00	0.00
180	688292	浩瀚深度	300	5,580.00	0.00
181	301177	迪阿股份	200	5,514.00	0.00
182	300433	蓝思科技	100	5,366.00	0.00
183	600585	海螺水泥	300	5,085.00	0.00
184	601166	兴业银行	300	4,968.00	0.00
185	300973	立高食品	200	4,914.00	0.00
186	300504	天邑股份	300	4,839.00	0.00
187	603898	好莱客	300	4,785.00	0.00
188	300837	浙矿股份	200	4,752.00	0.00
189	000776	广发证券	200	4,680.00	0.00
190	002128	电投能源	200	4,624.00	0.00
191	601026	道生天合	316	4,607.28	0.00
192	688051	佳华科技	200	4,596.00	0.00
193	000423	东阿阿胶	100	4,536.00	0.00
194	601137	博威合金	200	4,466.00	0.00
195	002468	申通快递	300	4,368.00	0.00
196	003006	百亚股份	300	4,353.00	0.00
197	300745	欣锐科技	100	4,222.00	0.00

198	603382	海阳科技	245	4,201.75	0.00
199	688058	宝兰德	200	4,184.00	0.00
200	002250	联化科技	300	4,101.00	0.00
201	301498	乖宝宠物	100	4,059.00	0.00
202	688329	艾隆科技	200	4,042.00	0.00
203	603194	中力股份	110	4,021.60	0.00
204	002853	皮阿诺	200	4,016.00	0.00
205	000680	山推股份	399	4,009.95	0.00
206	603395	红四方	200	4,000.00	0.00
207	002668	TCL智家	351	3,889.08	0.00
208	001872	招商港口	200	3,886.00	0.00
209	600771	广誉远	300	3,885.00	0.00
210	688021	奥福科技	200	3,872.00	0.00
211	600694	大商股份	286	3,783.78	0.00
212	601881	中国银河	300	3,771.00	0.00
213	605090	九丰能源	100	3,717.00	0.00
214	603596	伯特利	148	3,676.32	0.00
215	000885	城发环境	300	3,609.00	0.00
216	000830	鲁西化工	300	3,600.00	0.00
217	002273	水晶光电	100	3,548.00	0.00
218	300360	炬华科技	300	3,525.00	0.00
219	600161	天坛生物	300	3,474.00	0.00
220	000719	中原传媒	300	3,429.00	0.00
221	300662	科锐国际	200	3,396.00	0.00
222	300685	艾德生物	200	3,368.00	0.00
223	002705	新宝股份	300	3,324.00	0.00
224	002601	龙佰集团	200	3,296.00	0.00
225	600919	江苏银行	300	3,234.00	0.00
226	300783	三只松鼠	200	3,160.00	0.00
227	300616	尚品宅配	300	3,126.00	0.00
228	601633	长城汽车	200	3,018.00	0.00

229	000001	平安银行	300	3,015.00	0.00
230	600933	爱柯迪	200	2,956.00	0.00
231	603248	锡华科技	140	2,952.60	0.00
232	000783	长江证券	300	2,925.00	0.00
233	603408	建霖家居	300	2,895.00	0.00
234	601939	建设银行	300	2,889.00	0.00
235	600710	苏美达	300	2,868.00	0.00
236	301278	快可电子	100	2,840.00	0.00
237	601702	华峰铝业	200	2,820.00	0.00
238	300888	稳健医疗	100	2,799.00	0.00
239	301268	铭利达	200	2,796.00	0.00
240	600060	海信视像	100	2,787.00	0.00
241	605599	菜百股份	200	2,740.00	0.00
242	000338	潍柴动力	100	2,725.00	0.00
243	002891	中宠股份	100	2,672.00	0.00
244	300797	钢研纳克	200	2,652.00	0.00
245	601928	凤凰传媒	300	2,637.00	0.00
246	601577	长沙银行	300	2,613.00	0.00
247	603209	兴通股份	200	2,506.00	0.00
248	000039	中集集团	300	2,433.00	0.00
249	002459	晶澳科技	300	2,430.00	0.00
250	601555	东吴证券	300	2,376.00	0.00
251	603816	顾家家居	100	2,236.00	0.00
252	600909	华安证券	200	2,222.00	0.00
253	603508	思维列控	100	2,136.00	0.00
254	601128	常熟银行	363	2,112.66	0.00
255	605089	味知香	100	2,099.00	0.00
256	002608	江苏国信	300	2,070.00	0.00
257	601688	华泰证券	100	2,062.00	0.00
258	601225	陕西煤业	100	2,035.00	0.00
259	300599	雄塑科技	200	2,014.00	0.00

260	688176	亚虹医药	200	1,984.00	0.00
261	600273	嘉化能源	300	1,956.00	0.00
262	000951	中国重汽	100	1,951.00	0.00
263	601019	山东出版	300	1,920.00	0.00
264	600015	华夏银行	300	1,917.00	0.00
265	603210	泰鸿万立	142	1,907.06	0.00
266	002284	亚太股份	200	1,898.00	0.00
267	001206	依依股份	100	1,876.00	0.00
268	601211	国泰海通	100	1,820.00	0.00
269	600461	洪城环境	200	1,812.00	0.00
270	002967	广电计量	100	1,805.00	0.00
271	002557	洽洽食品	100	1,796.00	0.00
272	605338	巴比食品	100	1,790.00	0.00
273	603600	永艺股份	200	1,774.00	0.00
274	601001	晋控煤业	100	1,739.00	0.00
275	002600	领益智造	100	1,734.00	0.00
276	600031	三一重工	100	1,728.00	0.00
277	688148	芳源股份	200	1,716.00	0.00
277	601988	中国银行	300	1,716.00	0.00
278	600867	通化东宝	200	1,608.00	0.00
279	600012	皖通高速	100	1,576.00	0.00
280	000543	皖能电力	200	1,514.00	0.00
281	600827	百联股份	200	1,482.00	0.00
282	600873	梅花生物	200	1,470.00	0.00
283	600757	长江传媒	200	1,462.00	0.00
283	000537	绿发电力	200	1,462.00	0.00
284	600926	杭州银行	100	1,445.00	0.00
285	300035	中科电气	100	1,442.00	0.00
286	601717	中创智领	100	1,391.00	0.00
287	601998	中信银行	200	1,386.00	0.00
288	603367	辰欣药业	100	1,283.00	0.00

289	600269	赣粤高速	300	1,194.00	0.00
290	603766	隆鑫通用	100	1,193.00	0.00
291	601186	中国铁建	200	1,190.00	0.00
292	300305	裕兴股份	200	1,172.00	0.00
293	603809	豪能股份	130	1,140.10	0.00
294	603116	红蜻蜓	200	1,136.00	0.00
295	300437	清水源	100	1,126.00	0.00
296	600967	内蒙一机	100	1,085.00	0.00
297	600480	凌云股份	130	1,080.30	0.00
298	002533	金杯电工	100	1,067.00	0.00
299	600035	楚天高速	300	1,011.00	0.00
300	600968	海油发展	300	999.00	0.00
301	601658	邮储银行	200	986.00	0.00
302	002053	云南能投	100	983.00	0.00
303	002101	广东鸿图	100	954.00	0.00
304	600282	南钢股份	200	918.00	0.00
305	600236	桂冠电力	100	878.00	0.00
306	600642	申能股份	100	873.00	0.00
307	601229	上海银行	100	868.00	0.00
308	600000	浦发银行	100	861.00	0.00
309	601918	新集能源	100	859.00	0.00
310	300422	博世科	200	842.00	0.00
310	002003	伟星股份	100	842.00	0.00
311	601868	中国能建	300	801.00	0.00
312	603188	亚邦股份	200	792.00	0.00
313	000728	国元证券	100	749.00	0.00
314	600004	白云机场	100	726.00	0.00
315	300824	北鼎股份	100	718.00	0.00
316	603518	锦泓集团	100	715.00	0.00
317	002775	文科股份	200	682.00	0.00
318	601328	交通银行	100	643.00	0.00

319	601288	农业银行	100	607.00	0.00
320	601665	齐鲁银行	100	577.00	0.00
321	603609	禾丰股份	100	576.00	0.00
322	002948	青岛银行	100	508.00	0.00
323	601860	紫金银行	200	484.00	0.00
324	600863	华能蒙电	100	470.00	0.00
325	002408	齐翔腾达	100	469.00	0.00
326	002022	科华生物	100	458.00	0.00
327	600368	五洲交通	130	435.50	0.00
328	002701	奥瑞金	100	426.00	0.00
329	600219	南山铝业	100	399.00	0.00
330	601158	重庆水务	100	386.00	0.00
331	600575	淮河能源	100	319.00	0.00
332	603818	曲美家居	100	297.00	0.00
333	601818	光大银行	100	289.00	0.00
333	600665	天地源	100	289.00	0.00

注：自2026年07月28日起，股票代码为“688089”的股票名称由“嘉必优”变更为“ST嘉必优”；自2026年08月03日起，股票代码为“600439”的股票名称由“瑞贝卡”变更为“ST瑞贝卡”。

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	601330	绿色动力	1,455,108.00	0.95
2	600008	首创环保	1,392,578.00	0.91
3	000088	盐田港	1,389,787.00	0.91
4	600017	日照港	1,387,826.83	0.91
5	600690	海尔智家	1,382,297.93	0.90
6	601326	秦港股份	1,381,479.00	0.90

7	000563	陕国投A	1,378,783.00	0.90
8	601952	苏垦农发	1,369,723.00	0.89
9	000538	云南白药	1,368,911.00	0.89
10	001389	广合科技	1,252,442.00	0.82
11	300857	协创数据	1,241,976.00	0.81
12	603119	浙江荣泰	1,238,278.00	0.81
13	002743	富煌钢构	1,211,427.00	0.79
14	688152	麒麟信安	1,210,942.85	0.79
15	688111	金山办公	1,193,240.74	0.78
16	688670	金迪克	1,180,409.19	0.77
17	002463	沪电股份	1,179,809.00	0.77
18	600831	广电网络	1,175,556.00	0.77
19	300513	恒实科技	1,167,776.00	0.76
20	603192	汇得科技	1,162,210.00	0.76

注：“买入金额”按买入成交金额（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	300308	中际旭创	3,064,306.00	2.00
2	002475	立讯精密	2,780,927.00	1.82
3	300385	ST雪浪	2,520,175.00	1.64
4	300797	钢研纳克	2,382,303.00	1.56
5	002853	皮阿诺	2,150,377.00	1.40
6	601857	中国石油	1,713,060.00	1.12
7	600350	山东高速	1,656,426.00	1.08
8	300599	雄塑科技	1,589,955.00	1.04
9	600461	洪城环境	1,530,875.00	1.00
10	688215	瑞晟智能	1,481,243.92	0.97

11	688129	东来技术	1,396,308.41	0.91
12	002032	苏泊尔	1,394,601.00	0.91
13	600098	广州发展	1,386,467.00	0.90
14	688021	奥福科技	1,374,926.22	0.90
15	600273	嘉化能源	1,319,416.00	0.86
16	300504	天邑股份	1,291,613.00	0.84
17	603898	好莱客	1,291,286.00	0.84
18	600368	五洲交通	1,277,673.08	0.83
19	603116	红蜻蜓	1,234,501.00	0.81
20	002798	帝欧水华	1,206,471.00	0.79

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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	51,309,271.43
卖出股票收入（成交）总额	51,387,560.95

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.12.2 报告期内，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	1,480.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,868.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,349.06

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，本报告中涉及比例计算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 福瑞 混合 发起 （LO F）A	2,133	18,924.58	3,629,092.44	8.99%	36,737,028.72	91.01%
财通 福瑞 混合 发起 （LO F）C	19	5,569,040.83	105,684,701.80	99.88%	127,074.03	0.12%
合计	2,152	67,926.53	109,313,794.24	74.78%	36,864,102.75	25.22%

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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	62.21%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 （份）	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	财通福瑞混合发起 （LOF）A	0.00	0.00%
	财通福瑞混合发起 （LOF）C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	财通福瑞混合发起 （LOF）A	0
	财通福瑞混合发起 （LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	财通福瑞混合发起 （LOF）A	0
	财通福瑞混合发起 （LOF）C	0
	合计	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金管理人于2016年11月22日运用固有资金10,000,000.00元作为发起资金认购本基金，并于2020年10月13日赎回，发起份额持有期限满足不少于3年的承诺。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通福瑞混合发起（LOF）A	财通福瑞混合发起（LOF）C
基金合同生效日(2018年12月29日)基金份额总额	1,196,861,951.45	-
本报告期期初基金份额总额	36,940,293.44	105,742,839.16
本报告期基金总申购份额	7,089,448.67	222,223.07
减：本报告期基金总赎回份额	3,663,620.95	153,286.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,366,121.16	105,811,775.83

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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、本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。
- 2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内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

因内部控制需要，经履行适当程序，本基金管理人于2026年4月2日将本基金会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

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，管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华安	1	-	-	-	-	-

证券						
华西 证券	1	-	-	-	-	-
信达 证券	1	-	-	-	-	-
财通 证券	2	-	-	-	-	-
长江 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
方正 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国海 证券	2	-	-	-	-	-
国联 民生	2	1,166.00	0.00%	0.51	0.00%	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 海通 证券	2	693,468.00	0.68%	302.28	0.68%	-
国投 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
国元 证券	2	-	-	-	-	-
华创 证券	2	-	-	-	-	-
华福	2	-	-	-	-	-

证券						
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华源 证券	2	55,060,746.26	53.81%	24,001.29	53.81%	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	46,571,695.14	45.51%	20,300.99	45.51%	-
太平 洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	2	-	-	-	-	-
西南 证券	2	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-
浙商 证券	2	-	-	-	-	-
中国 银河	2	-	-	-	-	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-

中信 证券	2	-	-	-	-	-
中邮 证券	2	-	-	-	-	-
东方 证券	3	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司结合证券公司的财务状况、经营情况、合规风控能力、交易能力和研究能力完善证券公司的选择标准，证券交易单元所属证券公司需满足以下要求：

- (1)经营行为规范、合规内控制度健全；
- (2)具备高效、安全运作的通讯条件和稳定的交易系统，满足基金投资交易需求；
- (3)具备良好的市场形象和财务状况；
- (4)具备较强的研究及综合服务能力，具有专门的研究机构和专职研究人员；
- (5)被动股票型基金选择合作券商原则上应优先考虑交易服务能力。

公司对券商的服务评价严格遵循法律法规的相关要求，严禁与基金销售规模、保有规模挂钩，严禁以任何形式向证券公司承诺基金证券交易量及佣金或利用交易佣金与证券公司进行利益交换，严禁向第三方转移支付费用。被动股票型基金不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

- (1)公司建立交易单元管理审议机制，开展证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等审查机制，法律合规部及风险管理部进行前置性审查。
- (2)证券公司交易单元的办理由研究条线发起审批，经审批完成后，由相关部门办理后开通使用。研究条线每季度牵头对券商服务质量开展评价，根据券商服务评价结果，由公司审议当季股票交易量分配计划。
- (3)公司建立交易、投研、销售等业务隔离机制，基金销售业务人员不得参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

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

本基金本报告期内未租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	财通多策略福瑞混合型发起	中国证监会规定媒介	2026-01-22

	式证券投资基金（LOF）2025年第4季度报告		
2	财通基金管理有限公司关于旗下部分基金在东莞证券股份有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-24
3	财通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-28
4	财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
5	财通基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-02
6	财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
7	财通基金管理有限公司关于财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定媒介	2026-06-17
8	财通基金管理有限公司关于财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定媒介	2026-06-18
9	财通基金管理有限公司关于财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定媒介	2026-06-18

10	财通基金管理有限公司关于财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）二级市场交易价格溢价风险提示及停牌公告	中国证监会规定媒介	2026-06-22
11	财通基金管理有限公司关于财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定媒介	2026-06-22
12	财通基金管理有限公司关于财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定媒介	2026-06-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026-01-01至2026-06-30	31,714,568.88	-	-	31,714,568.88	21.70%
	2	2026-01-01至2026-06-30	31,714,568.88	-	-	31,714,568.88	21.70%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）基金合同；
- 3、财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）托管协议；
- 4、财通多策略福瑞混合型发起式证券投资基金（LOF）招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼。

12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：www.ctfund.com

财通基金管理有限公司
二〇二六年八月二十九日