

**财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）2025 年中期报告**

**2025 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:中国农业银行股份有限公司**

**送出日期:2025 年 08 月 30 日**

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月29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2025年01月01日起至2025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	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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45

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 .....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
§8 基金份额持有人信息 .....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
§9 开放式基金份额变动 .....	48
§10 重大事件揭示 .....	48
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
§12 备查文件目录 .....	52
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	财通多策略福享混合（LOF）
场内简称	财通福享混合LOF
基金主代码	501026
交易代码	501026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年09月18日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	140,919,800.64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	2016年12月15日

注：本基金自2018年3月17日转型为开放式基金（LOF）。

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、固定收益类资产投资策略、权证投资策略、股指期货的投资策略。
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。

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		中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	任航
	联系电话	021-20537888	010-66060069
	电子邮箱	service@ctfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-820-9888		95599
传真	021-68888169/021-68888661		010-68121816
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号505室		北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120		100031
法定代表人	吴林惠		谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ctfund.com
基金中期报告备置地点	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 (2025年01月01日 - 2025年06月30日)
---------------	------------------------------------

本期已实现收益	1,983,411.98
本期利润	8,039,119.33
加权平均基金份额本期利润	0.0557
本期加权平均净值利润率	7.01%
本期基金份额净值增长率	7.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)
期末可供分配利润	-16,607,557.79
期末可供分配基金份额利润	-0.1179
期末基金资产净值	124,312,242.85
期末基金份额净值	0.8821
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.28%

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

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	15.59%	1.52%	1.60%	0.31%	13.99%	1.21%
过去三个月	16.94%	1.98%	1.34%	0.59%	15.60%	1.39%
过去六个月	7.12%	2.03%	0.79%	0.55%	6.33%	1.48%
过去一年	17.77%	2.18%	10.52%	0.75%	7.25%	1.43%

过去三年	-14.95%	1.61%	0.40%	0.60%	-15.35%	1.01%
自基金转型起至今	-1.28%	1.49%	18.02%	0.68%	-19.30%	0.81%

### 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03月17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。

## §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。成立近14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130余项业内权威大奖。



截至2025年6月末，财通基金合计管理规模约1,048.19亿元，其中，公募基金管理规模约747.53亿元。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，坚信投资研究是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为核心，坚守初心、苦练内功，配备了一支专业投研团队，纵深一级半、二级市场，坚持为投资者创造价值。

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		
夏钦	本基金的基金经理	2019-07-03	-	17年	上海交通大学会计学硕士。历任上海申银万国证券研究所有限公司高级研究员，瑞银集团董事，平安资产管理有限责任公司策略研究经理。2015年9月加入财通基金管理有限公司，现任权益公募投资部基金经理。

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

本基金在报告期内维持在80-90%仓位运作，保持通过自上而下和自下而上结合，重点选择投资景气上行行业中的优秀公司，包括AI、高端制造、消费、医药等行业。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，财通多策略福享混合（LOF）基金份额净值为0.8821元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.12%，同期业绩比较基准收益率为0.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年，市场的运行逻辑与过去发生了较大改变，我们认为市场更加关注长期的逻辑，忽略短期的节奏和业绩，因此上半年是题材股层出不穷的时期，例如机器人、低空经济、创新药等等；而有长期逻辑，短期业绩不错的AI板块却没有充分受到市场关注，我们认为这与产业发展的过程以及市场的持仓拥挤度都有较大的关系。

在对AI投资的过程中，我们始终相信这是一个将持续数年的产业趋势，并且这是一场科技革命，在其中会有很多公司直接受益，我们应该看得更长远一些，才能把握住相关的投资机会。所以我们在上半年的回调中并没有进行太大调整，这也导致了今年净值出现较为明显的波动，但所幸二季度后期市场在看到海外的产业状况后，修正了此前对产业的观点，相关的公司也出现了明显反弹，为本基金带来了较大的超额收益。

事实证明，我们坚持投资于具备核心竞争力和良好发展前景的AI公司是正确的。在市场情绪回暖、行业发展逻辑逐渐清晰后，这些公司展现出强大的增长潜力，我们认为可以专注于那些在行业中具有领先地位和优秀商业模式的公司，不为短期市场波动所左右。展望未来，我们将继续秉持这一理念，深入挖掘具有潜力的投资机会，力求为投资者创造持续的回报。

但从最大回撤的角度来说，我们是值得反思的。特别是近年来，市场开始呈现情绪化波动加大的状态，股价对于短期利空常常可能会过度反应，我们认为这或许与市场持仓结构和投资者的理念息息相关。在这种市场环境下，我们未来也需要对于一些可能造成较大影响的短期利空进行评估，力求降低回撤。

最后，我们未来仍会更加积极地寻找具有长期成长空间、符合未来行业趋势的优秀企业，争取能够在未来为投资者创造更多价值。

#### 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，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%。

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，本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-财通基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，财通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，财通基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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：财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	18,160,652.94	13,623,775.20
结算备付金		301,013.54	516,394.85
存出保证金		83,475.84	95,321.52
交易性金融资产	6.4.7.2	111,061,651.22	103,023,675.87

其中：股票投资		111,061,651.22	103,023,675.87
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		-	3,537,939.70
应收股利		-	-
应收申购款		236,257.12	2,376.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		129,843,050.66	120,799,483.91
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年06月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,135,626.15	-
应付赎回款		36,272.96	39,206.92
应付管理人报酬		117,318.12	120,824.62
应付托管费		19,553.00	20,137.44
应付销售服务费		-	-
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	222,037.58	321,144.49
负债合计		5,530,807.81	501,313.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	140,919,800.64	146,076,309.10
未分配利润	6.4.7.8	-16,607,557.79	-25,778,138.66
净资产合计		124,312,242.85	120,298,170.44
负债和净资产总计		129,843,050.66	120,799,483.91

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额净值0.8821元，基金份额总额140,919,800.64份。

6.2 利润表

会计主体：财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		8,928,313.54	6,015,777.50
1.利息收入		27,306.66	49,519.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	27,306.66	49,519.14
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		2,820,036.61	-3,665,963.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,125,935.16	-4,511,644.86
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	694,101.45	845,681.83
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	6,055,707.35	9,626,604.51
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	25,262.92	5,616.88
<b>减：二、营业总支出</b>		889,194.21	858,109.63
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	683,318.32	656,820.55
2.托管费	6.4.10.2.2	113,886.34	109,470.06
3.销售服务费		-	-
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	91,989.55	91,819.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,039,119.33	5,157,667.87
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,039,119.33	5,157,667.87
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		8,039,119.33	5,157,667.87

### 6.3 净资产变动表

会计主体：财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	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	146,076,309.10	-25,778,138.66	120,298,170.44
二、本期期初净资产	146,076,309.10	-25,778,138.66	120,298,170.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,156,508.46	9,170,580.87	4,014,072.41
（一）、综合收益总额	-	8,039,119.33	8,039,119.33
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-5,156,508.46	1,131,461.54	-4,025,046.92
其中：1.基金申购款	5,781,129.96	-1,075,062.73	4,706,067.23
2.基金赎回款	-10,937,638.42	2,206,524.27	-8,731,114.15
（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	140,919,800.64	-16,607,557.79	124,312,242.85
项 目	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024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	154,488,344.16	-44,010,626.27	110,477,717.89
二、本期期初净资产	154,488,344.16	-44,010,626.27	110,477,717.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,710,146.93	6,169,464.37	2,459,317.44
（一）、综合收益总额	-	5,157,667.87	5,157,667.87
（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）	-3,710,146.93	1,011,796.50	-2,698,350.43
其中：1.基金申购款	672,714.77	-177,914.14	494,800.63
2.基金赎回款	-4,382,861.70	1,189,710.64	-3,193,151.06
（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	150,778,197.23	-37,841,161.90	112,937,035.33

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

财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），由财通多策略福享混合型证券投资基金转型而成，财通多策略福享混合型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]1432号文《关于准予财通多策略福享混合型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9月18日正式生效。首次设立募集规模为4,583,560,764.88份基金份额。根据《财通多策略福享混合型证券投资基金基金合同》及《关于财通多策略福享混合型证券投资基金转换为上市开放式基金（LOF）的公告》，本基金自2018年3月17日起转型为上市开放式基金（LOF）并更名为财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）。本基金为契约型开放式，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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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、中期票据、短期融资券、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30%-95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种以及货币市场工具的比例为基金资产的0%-70%；在封闭期内，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，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。

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

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《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。

#### 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财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2025年06月30日的财务状况、自2025年01月01日起至2025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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

d) 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

### 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 2025年06月30日
活期存款	18,160,652.94
等于：本金	18,158,700.67
加：应计利息	1,952.27
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	18,160,652.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		95,669,071.58	-	111,061,651.22	15,392,579.64
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		95,669,071.58	-	111,061,651.22	15,392,579.64

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 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4.20
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	141,625.26
其中：交易所市场	141,625.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,408.12
合计	222,037.58

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,076,309.10	146,076,309.10
本期申购	5,781,129.96	5,781,129.96
本期赎回（以“-”号填列）	-10,937,638.42	-10,937,638.42
本期末	140,919,800.64	140,919,800.64

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

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
上年度末	8,809,297.40	-34,587,436.06	-25,778,138.66

本期期初	8,809,297.40	-34,587,436.06	-25,778,138.66
本期利润	1,983,411.98	6,055,707.35	8,039,119.33
本期基金份额交易产生的变动数	-246,571.41	1,378,032.95	1,131,461.54
其中：基金申购款	371,401.80	-1,446,464.53	-1,075,062.73
基金赎回款	-617,973.21	2,824,497.48	2,206,524.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,546,137.97	-27,153,695.76	-16,607,557.79

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	26,450.85
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	675.28
其他	180.53
合计	27,306.66

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	313,065,378.77
减：卖出股票成本总额	310,470,179.59
减：交易费用	469,264.02
买卖股票差价收入	2,125,935.16

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

本基金本报告期未有债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期未有债券买卖差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

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 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	694,101.45
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	694,101.45

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	6,055,707.35
——股票投资	6,055,707.35
——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	6,055,707.35

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	25,262.92
合计	25,262.92

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 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,981.43
账户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	91,989.55

## 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
中国农业银行股份有限公司("农业银行")	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 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	683,318.32	656,820.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	264,050.08	228,724.63
应支付基金管理人的净管理费	419,268.24	428,095.92

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1.20%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×1.20%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	113,886.34	109,470.06

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0.20%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×0.20%/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

本基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024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
农业银行	18,160,652.94	26,450.85	14,885,896.08	46,516.85

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（2025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	证券	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	（单位：股）	成本总额	估值总额	
688775	影石创新	2025-06-04	6个月	新股限售	47.27	124.16	88	4,159.76	10,926.08	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月	新股限售	19.88	43.81	48	954.24	2,102.88	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6个月	新股限售	15.00	33.43	56	840.00	1,872.08	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6个月	新股限售	11.50	22.39	76	874.00	1,701.64	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6个月	新股限售	24.18	33.32	46	1,112.28	1,532.72	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项	38.05	2025-07-11	39.98	62,563	2,009,788.24	2,380,522.15	-

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2025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2025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农业银行，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 2025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	18,160,652.94	-	-	-	-	-	18,160,652.94
结算备付金	301,013.54	-	-	-	-	-	301,013.54
存出保证金	83,475.84	-	-	-	-	-	83,475.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	111,061,651.22	111,061,651.22
应收申购款	-	-	-	-	-	236,257.12	236,257.12
资产	18,545,142.32	-	-	-	-	111,297,908.34	129,843,050.66



总计							
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	5,135,626.15	5,135,626.15
应付赎回款	-	-	-	-	-	36,272.96	36,272.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	117,318.12	117,318.12
应付托管费	-	-	-	-	-	19,553.00	19,553.00
其他负债	-	-	-	-	-	222,037.58	222,037.58
负债总计	-	-	-	-	-	5,530,807.81	5,530,807.81
利率敏感度缺口	18,545,142.32	-	-	-	-	105,767,100.53	124,312,242.85
上年度末2024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	13,623,775.20	-	-	-	-	-	13,623,775.20

结算 备付 金	516,394.85	-	-	-	-	-	516,394.85
存出 保证 金	95,321.52	-	-	-	-	-	95,321.52
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	103,023,675.8 7	103,023,675.8 7
应收 清算 款	-	-	-	-	-	3,537,939.70	3,537,939.70
应收 申购 款	-	-	-	-	-	2,376.77	2,376.77
资产 总计	14,235,491.5 7	-	-	-	-	106,563,992.3 4	120,799,483.9 1
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	39,206.92	39,206.92
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	120,824.62	120,824.62
应付 托管 费	-	-	-	-	-	20,137.44	20,137.44
其他 负债	-	-	-	-	-	321,144.49	321,144.49
负债 总计	-	-	-	-	-	501,313.47	501,313.47

利率 敏感 度缺 口	14,235,491.5 7	-	-	-	-	106,062,678.8 7	120,298,170.4 4
---------------------	-------------------	---	---	---	---	--------------------	--------------------

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

本基金本期末及上年度末均未持有交易性固定收益类投资（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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30%-95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益品种以及货币市场工具的比例为基金资产的0%-70%；在封闭期内，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，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 2025年06月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	111,061,651.22	89.34	103,023,675.87	85.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	111,061,651.22	89.34	103,023,675.87	85.64

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准增加1%	2,771,684.09	2,648,413.55

	业绩比较基准减少1%	-2,771,684.09	-2,648,413.55
--	------------	---------------	---------------

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	108,662,993.67	103,011,205.63
第二层次	2,380,522.15	-
第三层次	18,135.40	12,470.24
合计	111,061,651.22	103,023,675.87

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2025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(2024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2025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	111,061,651.22	85.54
	其中：股票	111,061,651.22	85.54
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	18,461,666.48	14.22
8	其他各项资产	319,732.96	0.25
9	合计	129,843,050.66	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	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	97,360,649.62	78.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,968.00	0.06
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	273,710.00	0.22
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	13,202,876.60	10.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	46,846.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	89,800.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,151.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,650.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	111,061,651.22	89.34

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	300502	新易盛	95,782	12,166,229.64	9.79
2	688183	生益电子	237,100	12,139,520.00	9.77
3	603129	春风动力	36,100	7,815,650.00	6.29
4	603893	瑞芯微	50,900	7,729,674.00	6.22
5	688200	华峰测控	44,538	6,422,379.60	5.17

6	688205	德科立	99,350	6,228,251.50	5.01
7	688256	寒武纪	10,038	6,037,857.00	4.86
8	002463	沪电股份	132,000	5,620,560.00	4.52
9	002345	潮宏基	337,100	4,931,773.00	3.97
10	688608	恒玄科技	14,028	4,881,463.44	3.93
11	300394	天孚通信	51,256	4,092,279.04	3.29
12	002335	科华数据	86,600	3,696,088.00	2.97
13	688018	乐鑫科技	24,666	3,603,702.60	2.90
14	300458	全志科技	87,000	3,453,030.00	2.78
15	002517	恺英网络	174,700	3,373,457.00	2.71
16	603256	宏和科技	172,500	2,556,450.00	2.06
17	688313	仕佳光子	62,563	2,380,522.15	1.91
18	002891	中宠股份	38,400	2,375,808.00	1.91
19	003006	百亚股份	83,900	2,297,182.00	1.85
20	301061	匠心家居	19,305	1,496,909.70	1.20
21	300537	广信材料	58,300	1,494,229.00	1.20
22	300888	稳健医疗	29,700	1,220,670.00	0.98
23	688037	芯源微	10,082	1,080,790.40	0.87
24	603193	润本股份	27,900	876,339.00	0.70
25	600809	山西汾酒	2,400	423,336.00	0.34
26	688041	海光信息	2,857	403,665.53	0.32
27	300570	太辰光	2,700	260,226.00	0.21
28	300972	万辰集团	1,100	198,264.00	0.16
29	003010	若羽臣	3,100	187,860.00	0.15
30	688799	华纳药厂	3,592	148,349.60	0.12
31	000880	潍柴重机	3,100	117,242.00	0.09
32	688068	热景生物	826	115,755.64	0.09
33	688382	益方生物	3,514	115,329.48	0.09
34	300723	一品红	2,200	110,264.00	0.09
35	600690	海尔智家	4,379	108,511.62	0.09
36	603766	隆鑫通用	8,000	102,080.00	0.08



37	605499	东鹏饮料	300	94,215.00	0.08
38	002475	立讯精密	2,700	93,663.00	0.08
39	002938	鹏鼎控股	2,900	92,887.00	0.07
40	301096	百诚医药	2,000	89,800.00	0.07
41	002847	盐津铺子	1,100	88,440.00	0.07
42	603517	绝味食品	5,500	83,875.00	0.07
43	300945	曼卡龙	3,400	75,446.00	0.06
44	601985	中国核电	7,400	68,968.00	0.06
45	002127	南极电商	11,800	46,846.00	0.04
46	603400	华之杰	474	26,546.76	0.02
47	000516	国际医学	3,100	16,151.00	0.01
48	688775	影石创新	88	10,926.08	0.01
49	002422	科伦药业	100	3,592.00	0.00
50	300364	中文在线	100	2,650.00	0.00
51	603120	肯特催化	56	1,872.08	0.00
52	603382	海阳科技	76	1,701.64	0.00
53	603409	汇通控股	46	1,532.72	0.00
54	002550	千红制药	100	840.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	17,854,617.85	14.84
2	002345	潮宏基	14,516,775.00	12.07
3	688256	寒武纪	13,550,926.34	11.26
4	688200	华峰测控	11,584,137.78	9.63
5	603893	瑞芯微	10,973,043.00	9.12
6	688608	恒玄科技	10,867,660.46	9.03

7	688041	海光信息	10,841,512.71	9.01
8	603129	春风动力	8,888,366.00	7.39
9	300570	太辰光	8,548,546.00	7.11
10	688205	德科立	8,395,471.80	6.98
11	688018	乐鑫科技	7,719,895.69	6.42
12	002335	科华数据	7,579,593.00	6.30
13	603193	润本股份	7,525,554.00	6.26
14	603766	隆鑫通用	6,998,442.00	5.82
15	300888	稳健医疗	6,565,371.60	5.46
16	688313	仕佳光子	6,548,042.56	5.44
17	688800	瑞可达	6,402,118.01	5.32
18	688183	生益电子	5,854,189.34	4.87
19	300738	奥飞数据	5,682,057.93	4.72
20	300548	博创科技	5,113,183.00	4.25
21	300153	科泰电源	4,858,067.00	4.04
22	300458	全志科技	4,442,323.00	3.69
23	300394	天孚通信	4,356,587.20	3.62
24	003006	百亚股份	4,016,297.00	3.34
25	002779	中坚科技	3,959,667.00	3.29
26	002463	沪电股份	3,791,392.00	3.15
27	600809	山西汾酒	3,682,509.00	3.06
28	002484	江海股份	3,522,055.00	2.93
29	000880	潍柴重机	3,470,940.00	2.89
30	002928	华夏航空	3,464,747.00	2.88
31	300014	亿纬锂能	3,381,363.00	2.81
32	600383	金地集团	3,347,474.00	2.78
33	600315	上海家化	3,286,793.00	2.73
34	605499	东鹏饮料	3,266,071.00	2.71
35	603517	绝味食品	3,256,301.00	2.71
36	002517	恺英网络	3,128,669.00	2.60
37	603881	数据港	3,119,115.06	2.59

38	301061	匠心家居	2,950,402.00	2.45
39	002847	盐津铺子	2,921,547.40	2.43
40	688361	中科飞测	2,839,552.52	2.36
41	300945	曼卡龙	2,687,169.00	2.23
42	300972	万辰集团	2,678,904.00	2.23
43	301383	天键股份	2,516,157.00	2.09
44	002891	中宠股份	2,502,813.00	2.08
45	300364	中文在线	2,416,572.00	2.01

注：(1)“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；

(2)自2025年7月2日起，证券代码为“300548”的证券简称由“博创科技”变更为“长芯博创”。

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	300502	新易盛	19,538,238.00	16.24
2	002345	潮宏基	12,641,653.00	10.51
3	688041	海光信息	12,438,514.11	10.34
4	688608	恒玄科技	11,489,547.03	9.55
5	600809	山西汾酒	10,001,603.76	8.31
6	603129	春风动力	9,509,178.00	7.90
7	002463	沪电股份	9,067,842.00	7.54
8	603766	隆鑫通用	8,256,885.00	6.86
9	301061	匠心家居	8,252,334.00	6.86
10	002127	南极电商	7,589,105.00	6.31
11	688256	寒武纪	7,544,976.15	6.27
12	300570	太辰光	6,995,076.95	5.81
13	688676	金盘科技	6,438,819.02	5.35
14	603193	润本股份	6,296,168.00	5.23

15	601028	玉龙股份	6,248,826.00	5.19
16	688183	生益电子	5,660,855.65	4.71
17	688313	仕佳光子	5,339,444.93	4.44
18	688800	瑞可达	5,261,701.13	4.37
19	300888	稳健医疗	5,139,305.86	4.27
20	600694	大商股份	5,131,696.70	4.27
21	002779	中坚科技	5,046,619.00	4.20
22	300548	博创科技	5,037,518.00	4.19
23	003010	若羽臣	4,939,886.40	4.11
24	300738	奥飞数据	4,902,750.00	4.08
25	688981	中芯国际	4,765,561.38	3.96
26	688200	华峰测控	4,639,799.85	3.86
27	688205	德科立	3,804,223.83	3.16
28	300153	科泰电源	3,751,232.00	3.12
29	002928	华夏航空	3,514,646.00	2.92
30	002335	科华数据	3,431,415.00	2.85
31	688018	乐鑫科技	3,376,495.65	2.81
32	605499	东鹏饮料	3,317,694.60	2.76
33	002484	江海股份	3,304,908.00	2.75
34	600315	上海家化	3,269,790.00	2.72
35	000880	潍柴重机	3,266,485.00	2.72
36	600383	金地集团	3,117,812.00	2.59
37	300014	亿纬锂能	3,098,122.00	2.58
38	002847	盐津铺子	3,091,765.00	2.57
39	601579	会稽山	3,062,432.00	2.55
40	603988	中电电机	3,055,464.00	2.54
41	603517	绝味食品	3,017,931.00	2.51
42	300972	万辰集团	2,997,559.00	2.49
43	603893	瑞芯微	2,978,389.00	2.48
44	300945	曼卡龙	2,786,627.00	2.32
45	600328	中盐化工	2,741,921.70	2.28

46	603881	数据港	2,694,153.00	2.24
47	688361	中科飞测	2,654,600.25	2.21
48	300364	中文在线	2,496,480.00	2.08

注：(1)“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；

(2)自2025年7月2日起，证券代码为“300548”的证券简称由“博创科技”变更为“长芯博创”。

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	312,452,447.59
卖出股票收入（成交）总额	313,065,378.77

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

7.12.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规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	83,475.84
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	236,257.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	319,732.96

### 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不存在流通受限的股票。

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

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
2,664	52,897.82	9,837,449.89	6.98%	131,082,350.75	93.02%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	黄久芳	992,918.00	7.15%
2	章斌	870,000.00	6.26%
3	范一琴	582,055.00	4.19%
4	陆祥焕	543,824.00	3.91%
5	赵真	494,521.00	3.56%
6	关庆瑜	494,206.00	3.56%
7	曾月群	444,116.00	3.20%
8	吴龙	395,490.00	2.85%
9	毛伟松	356,576.00	2.57%
10	张啸然	356,576.00	2.57%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	49,409.72	0.04%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年09月18日)基金份额总额	4,583,560,764.88
本报告期期初基金份额总额	146,076,309.10
本报告期基金总申购份额	5,781,129.96
减：本报告期基金总赎回份额	10,937,638.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	140,919,800.64

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，本基金管理人于2025年5月14日聘任刘江女士担任总经理助理职务。
- 2、2025年2月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁；2025年3月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁；2025年4月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金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



本报告期内本基金未改聘会计师事务所，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025年01月07日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	部分业务管理不规范
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无
措施2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2025年01月07日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分业务管理不规范
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	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	佣金	占当期佣金总	

	元 数 量		交总额 的比例		量的比 例	
财通 证券	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	30,517,557.38	4.88%	13,302.54	4.88%	-
广发 证券	2	594,921,178.00	95.12%	259,325.31	95.12%	-
国泰 海通	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-

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	财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）2024年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
2	财通基金管理有限公司关于财通多策略福享混合型证券投资基金（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	2025-03-03
3	财通基金管理有限公司关于财通多策略福享混合型证券投资基金（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	2025-03-04
4	财通基金管理有限公司关于财通多策略福享混合型证券投资基金（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	2025-03-05
5	财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）2024年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-29
6	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（2024年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
7	财通基金管理有限公司关于财通多策略福享混合型证券投资基金（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	2025-04-08

8	财通基金管理有限公司关于财通多策略福享混合型证券投资基金（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	2025-04-09
9	财通基金管理有限公司关于财通多策略福享混合型证券投资基金（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	2025-04-10
10	财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）2025年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
11	关于民商基金销售（上海）有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2025-05-30
12	财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2025年06月27日公告）	中国证监会规定媒介	2025-06-27
13	财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新（2025年06月27日公告）	中国证监会规定媒介	2025-06-27

## §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有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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）基金合同；
- 3、财通多策略福享混合型证券投资基金（LOF）托管协议；
- 4、财通多策略福享混合型证券投资基金（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  
二〇二五年八月三十日