

# 融通核心价值混合型证券投资基金（QDII） 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：融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：2023 年 3 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。本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2023 年 3 月 24 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	12
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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	49

8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	49
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	50
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	50
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	51
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	54
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	54
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	54
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	54
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	54
8.11 投资组合报告附注 .....	55
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
9.3 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 .....	56
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
11.2 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
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
11.4 基金投资策略的改变 .....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
11.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
12.1 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
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录 .....	61
13.2 存放地点 .....	61
13.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）	
基金简称	融通核心价值混合（QDII）	
基金主代码	161620	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 4 日	
基金管理人	融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	69,646,673.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通核心价值混合（QDII）A	融通核心价值混合（QDII）C
下属分级基金的交易代码	161620	014127
报告期末下属分级基金的份额总额	67,809,784.37 份	1,836,889.18 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，精选出具有全球竞争力和核心价值的公司进行投资，追求基金资产长期稳健增值，力争为基金份额持有人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	<p>本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。</p> <p>在资产配置中，本基金主要考虑宏观经济指标，包括 PMI 水平、GDP 增长率、M2 增长率及趋势、PPI、CPI、利率水平与变化趋势、宏观经济政策等，来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向。</p> <p>在经济周期各阶段，综合对所跟踪的宏观经济指标和市场指标的分析，本基金对大类资产进行配置的策略为：在经济的复苏和繁荣期超配股票资产；在经济的衰退和政策刺激阶段，超配债券等固定收益类资产，力争通过资产配置获得部分超额收益。</p>
业绩比较基准	恒生指数（Hang Seng Index）收益率×70%+中债综合全价（总值）指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755)26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	13、14 层	
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518053	100140
法定代表人	张威	陈四清

#### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	NY 10005

#### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

#### 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2022 年		2021 年		2020 年
	融通核心价值混合(QDII) A	融通核心价值混合(QDII) C	融通核心价值混合(QDII) A	融通核心价值混合(QDII) C	融通核心价值混合(QDII) A
本期已实现收益	-20,250,386.21	-316,849.63	-10,842,065.04	-11,473.55	17,264,085.87
本期利润	-21,049,143.99	-262,227.28	-13,590,050.65	-5,362.94	19,780,155.89
加权平均基金份额本期利润	-0.2898	-0.2158	-0.1480	-0.0364	0.3832
本期加权平均净值利润率	-34.38%	-26.54%	-13.31%	-3.25%	45.99%
本期基金份额净值增长率	-26.72%	-27.18%	-5.71%	-2.29%	55.53%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末

期末可供分配利润	-16,622,146.56	-459,274.19	2,522,913.34	10,183.39	3,301,213.60
期末可供分配基金份额利润	-0.2451	-0.2500	0.0302	0.0299	0.0926
期末基金资产净值	51,187,637.81	1,377,614.99	85,989,567.25	350,970.14	38,943,037.21
期末基金份额净值	0.7549	0.7500	1.0302	1.0299	1.0926
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末
基金份额累计净值增长率	6.48%	-28.85%	45.30%	-2.29%	54.10%

注：1、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。

2、本报告所列示的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。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通核心价值混合（QDII）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	-4.33%	1.19%	9.41%	1.63%	-13.74%	-0.44%
过去六个月	-10.42%	1.07%	-3.39%	1.31%	-7.03%	-0.24%
过去一年	-26.72%	1.11%	-4.32%	1.38%	-22.40%	-0.27%
过去三年	7.46%	1.25%	-19.95%	1.12%	27.41%	0.13%
自基金合同生效起至今	6.48%	1.12%	-11.23%	1.02%	17.71%	0.10%

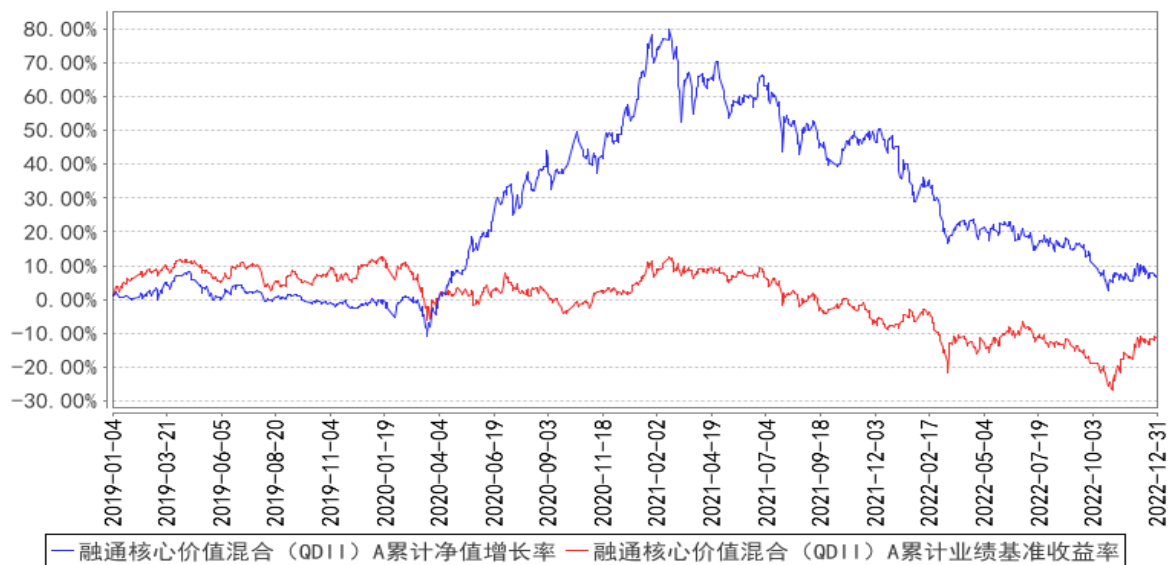
融通核心价值混合（QDII）C

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	-4.45%	1.19%	9.41%	1.63%	-13.86%	-0.44%
过去六个月	-10.64%	1.07%	-3.39%	1.31%	-7.25%	-0.24%
过去一年	-27.18%	1.11%	-4.32%	1.38%	-22.86%	-0.27%
自基金合同生效 起至今	-28.85%	1.09%	-8.61%	1.33%	-20.24%	-0.24%

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

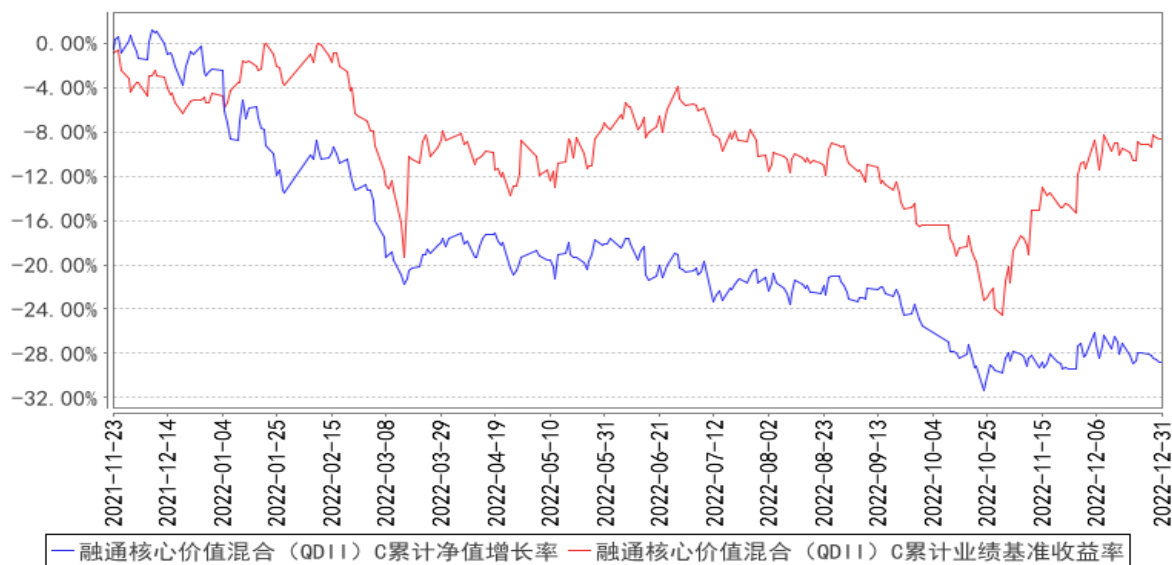
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

融通核心价值混合（QDII）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





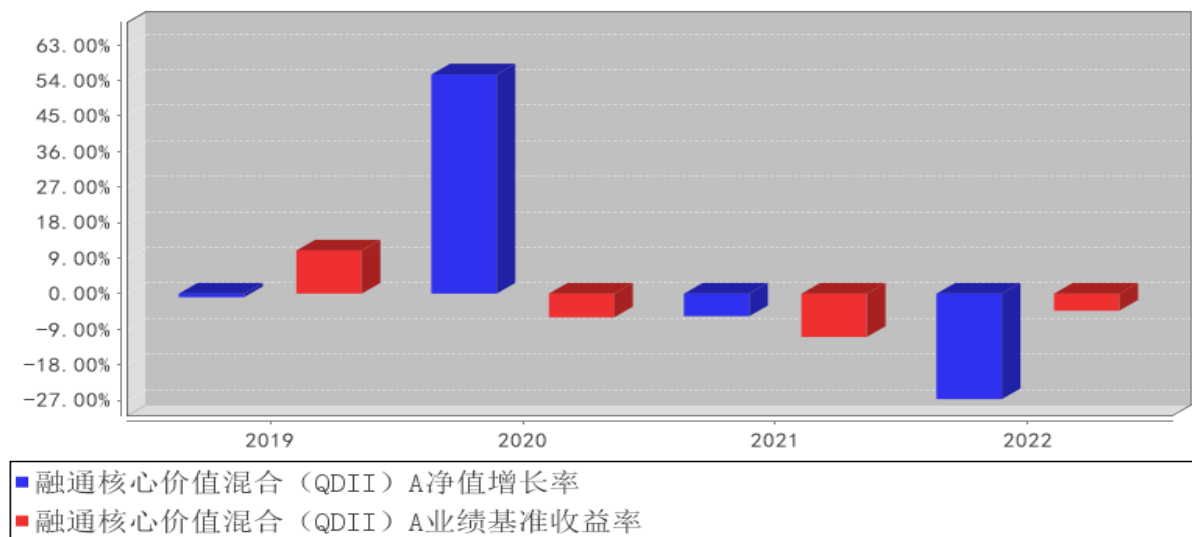
融通核心价值混合（QDII）C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



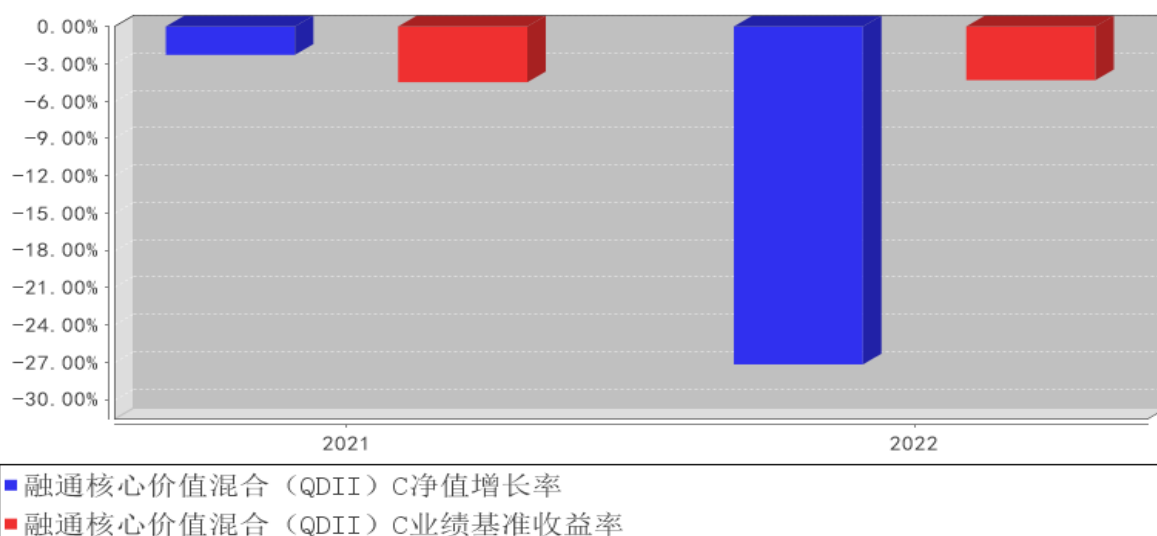
注：本基金于2021年11月22日增设C类份额，该类份额首次确认日为2021年11月23日，故本基金C类份额的统计区间为2021年11月23日至本报告期末。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通核心价值混合（QDII）A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



融通核心价值混合（QDII）C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金 A 类份额的基金合同生效日为 2019 年 1 月 4 日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

2、本基金 C 类份额于 2021 年 11 月 22 日增设，该类份额确认当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

融通核心价值混合（QDII）A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

融通核心价值混合（QDII）C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：诚通证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、境内合格机构管理人资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境外机构投资者（RQFII）资格、合格境外机构投资者（QFII）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII基金等等。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张婷	本基金的基金经理	2019/1/12	-	10	张婷女士，悉尼大学会计硕士，10年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2011年3月至2014年3月就职于华泰柏瑞基金管理有限公司任研究员，2014年4月至2015年12月就职于嘉实基金管理有限公司任投资经理，2016年1月至2016年6月任职于易方达基金管理有限公司。2017年10月加入融通基金管理有限公司，历任国际业务部研究员、融通丰利四分法证券投资基金基金经理，现任融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金经理、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

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

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2022 年全年，港股呈现出标准的“W”型的走势，纳斯达克指数则呈现出双“W”型的走势，熊冠全球。整体来看，中国资产无论是 A 股还是港股的表现均优于美股，但相对于 A 股而言，港股表现更为落后。宏观大环境总的来说，在美联储加息、通胀高企、俄乌冲突等的利空影响之下，海外股票市场全年都是大幅震荡，不过随着疫情对经济活动影响逐渐退潮，稳增长政策开始逐步落地，港股在年底开启了反弹之路，在全球波动市场中走出了独立行情。在这些背景下，投资策略上，综合基本面和政策面等因素，我们在上半年注重均衡配置，在周期板块中对全球服务业复苏敞口更大的石油石化、供需关系紧张的航运板块增加了配置。从规避政策风险的角度，减少了对互联网科技，地产和金融板块的配置。下半年，我们认为疫情修复预期推动市场反弹，所以在四季度增加了对港股科技互联网龙头的配置，尤其是对成长板块中的估值回落较大的优质龙头逆势加仓，同时积极配置了资金宽松与疫情修复两条主线下的优质标的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通核心价值混合（QDII）A 基金份额净值为 0.7549 元，本报告期基金份额净值增长率为-26.72%，同期业绩比较基准收益率为-4.32%；

截至本报告期末融通核心价值混合（QDII）C 基金份额净值为 0.7500 元，本报告期基金份额净值增长率为-27.18%，同期业绩比较基准收益率为-4.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，我们认为港股股票市场有望迎来新一轮上行周期。首先，随着海外通胀回落、美债利率开始走低，我们认为拖滞港股流动性的情况将得到大幅的缓解，其次，同时随着国内生产、消费逐渐恢复正常和各项政策的放松，港股中资股有望重回上行趋势，迎来景气反转。第三，港股估值已经处于历史较低位置，下行风险有限，具备充分的向上重估的空间。2023 年我们有望看到一个企业盈利好转，估值修复和流动性改善的三方面共同驱动的港股市场。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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——融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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年年度报告中财务指标、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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 21822 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)全体基金份额持有人：
审计意见	<p>（一）我们审计的内容</p> <p>我们审计了融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)（以下简称“融通核心价值混合基金”）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>（二）我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了融通核心价值混合基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>融通核心价值混合基金的基金管理人融通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或</p>

	<p>汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	沈兆杰   陈邗迤
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2023 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	19,466,349.31	40,305,959.49
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	34,359,781.53	59,184,772.70



其中：股票投资		34,359,781.53	59,184,772.70
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		12,019.84	8,462.16
应收申购款		133,483.05	197,518.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	529.41
资产总计		53,971,633.73	99,697,241.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		902,961.33	12,379,747.27
应付赎回款		298,694.86	763,354.21
应付管理人报酬		68,259.90	112,564.76
应付托管费		11,376.64	18,760.82
应付销售服务费		569.62	84.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,000.06	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	115,518.52	82,193.11
负债合计		1,406,380.93	13,356,704.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	69,646,673.55	83,807,440.66
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-17,081,420.75	2,533,096.73
净资产合计		52,565,252.80	86,340,537.39

负债和净资产总计		53,971,633.73	99,697,241.98
----------	--	---------------	---------------

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 69,646,673.55 份，其中融通核心价值混合(QDII)A 类基金份额 67,809,784.37 份，基金份额净值 0.7549 元；融通核心价值混合(QDII)C 类基金份额 1,836,889.18 份，基金份额净值 0.7500 元。

## 7.2 利润表

会计主体：融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-20,094,137.48	-10,859,474.42
1. 利息收入		141,686.28	27,485.57
其中：存款利息收入	7.4.7.13	141,686.28	27,485.57
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-21,200,035.91	-7,950,702.25
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-23,706,572.96	-9,979,492.54
基金投资收益	7.4.7.15	390,783.60	-37,642.35
债券投资收益	7.4.7.16	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	2,115,753.45	2,066,432.64
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益	7.4.7.21	-744,135.43	-2,741,875.00
4. 汇兑收益		1,659,341.11	-876,223.68
5. 其他收入	7.4.7.22	49,006.47	681,840.94
<b>减：二、营业总支出</b>		1,217,233.79	2,735,939.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	939,234.08	1,534,614.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	156,538.85	255,769.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,882.89	84.49
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	7.4.7.23	-	-

7. 税金及附加		1,432.97	-
8. 其他费用	7.4.7.24	115,145.00	945,471.56
<b>三、利润总额</b>		-21,311,371.27	-13,595,413.59
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润</b>		-21,311,371.27	-13,595,413.59
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-21,311,371.27	-13,595,413.59

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	83,807,440.66	-	2,533,096.73	86,340,537.39
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	83,807,440.66	-	2,533,096.73	86,340,537.39
三、本期增减变动额	-14,160,767.11	-	-19,614,517.48	-33,775,284.59
（一）、综合收益总额	-	-	-21,311,371.27	-21,311,371.27
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-14,160,767.11	-	1,696,853.79	-12,463,913.32
其中：1. 基金申购款	22,562,676.81	-	-3,417,629.18	19,145,047.63
2. 基金赎回款	-36,723,443.92	-	5,114,482.97	-31,608,960.95
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	69,646,673.55	-	-17,081,420.75	52,565,252.80
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	35,641,823.61	-	3,301,213.60	38,943,037.21

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	35,641,823.61	-	3,301,213.60	38,943,037.21
三、本期增减变动额	48,165,617.05	-	-768,116.87	47,397,500.18
（一）、综合收益总额	-	-	-13,595,413.59	-13,595,413.59
（二）、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数	48,165,617.05	-	12,827,296.72	60,992,913.77
其中：1. 基金申购款	178,881,500.60	-	31,430,596.40	210,312,097.00
2. 基金赎回款	-130,715,883.55	-	-18,603,299.68	-149,319,183.23
（三）、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动	-	-	-	-
（四）、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	83,807,440.66	-	2,533,096.73	86,340,537.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张帆

高翔

刘美丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)(以下称“本基金”)是由融通丰利四分法证券投资基金转型而来。根据《融通丰利四分法证券投资基金合同》，原融通丰利四分法证券投资基金为契约型开放式基金。根据基金管理人融通基金管理有限公司于 2019 年 1 月 4 日发布的《关于融通丰利四分法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》，基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 3 日表决通过了《关于融通丰利四分法证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》，自 2019 年 1 月 4 日起，融通丰利四分法证券投资基金正式转型并更名为融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)。本基金为契约型开放式基金，存续期间不定。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行(BrownBrothersHarriman&Co.)。

根据《融通基金管理有限公司关于融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）增设 C 类基金

份额并修订基金合同部分条款的公告》及修改后的《融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金合同》的规定，本基金自 2021 年 11 月 22 日起增设 C 类基金份额。本基金根据销售服务费及申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，不从本类别基金资产中计提销售服务费且收取申购费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费且不收取申购费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金投资于境内境外市场。针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票(包含中小板、创业板、其他依法上市的股票)，衍生工具(股指期货、权证、国债期货等)，债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及现金；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)。针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(以下无特别说明，均包括 Exchange Traded Fund, ETF)；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股(包括港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票)、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。本基金投资组合中：股票投资占基金资产的比例为 30% - 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。本基金的业绩比较基准为：恒生指数(HangSengIndex)收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

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或金融负债。

###### (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商业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。

###### 债务工具

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商业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银行存款、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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

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。

#### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

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。本基金持有的其他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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

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；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。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，本基金对于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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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

持有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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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认列。

#### 7.4.4.8 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基金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基金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)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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。

#### 7.4.4.10 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逐日确认。

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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》（财会[2022]14 号），中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表时，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 40,305,959.49 元、529.41 元、8,462.16 元和 197,518.22 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息、应收股利和应收申购款，金额分别为 40,306,488.90 元、0.00 元、8,462.16 元和 197,518.22 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 59,184,772.70 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 59,184,772.70 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 12,379,747.27 元、763,354.21 元、112,564.76 元、18,760.82 元、84.42 元和 2,193.11 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款，金额分别为 12,379,747.27 元、763,354.21 元、112,564.76 元、18,760.82 元、84.42 元和 2,193.11 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额（如有）均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息（如有）分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	19,466,349.31	40,305,959.49
等于：本金	19,466,128.40	40,305,959.49
加：应计利息	220.91	-
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	19,466,349.31	40,305,959.49

注：于 2022 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 2,104,809.53 元，美元活期存款 1,526,459.63 元(折合人民币 10,631,180.74 元)，港币活期存款 7,534,518.16 元(折合人民币 6,730,359.04 元)。于 2021 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 6,306,502.99 元，美元活期存款 2,352,732.45 元(折合人民币 15,000,316.29 元)，港币活期存款 23,237,695.95 元(折合人民币 18,999,140.21 元)。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	35,724,679.39	-	34,359,781.53	-1,364,897.86
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	35,724,679.39	-	34,359,781.53	-1,364,897.86
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	59,805,535.13	-	59,184,772.70	-620,762.43
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	59,805,535.13	-	59,184,772.70	-620,762.43
----	---------------	---	---------------	-------------

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。



## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	529.41
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应计利息	-	-
合计	-	529.41

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	518.52	2,193.11
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	115,000.00	80,000.00
合计	115,518.52	82,193.11

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 融通核心价值混合（QDII）A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,466,653.91	83,466,653.91
本期申购	18,840,467.66	18,840,467.66
本期赎回（以“-”号填列）	-34,497,337.20	-34,497,337.20
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	67,809,784.37	67,809,784.37

## 融通核心价值混合（QDII）C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	340,786.75	340,786.75
本期申购	3,722,209.15	3,722,209.15

本期赎回（以“-”号填列）	-2,226,106.72	-2,226,106.72
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,836,889.18	1,836,889.18

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 融通核心价值混合（QDII）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	12,472,786.31	-9,949,872.97	2,522,913.34
本期利润	-20,250,386.21	-798,757.78	-21,049,143.99
本期基金份额交易产生的变动数	-670,815.19	2,574,899.28	1,904,084.09
其中：基金申购款	14,502.21	-2,802,643.16	-2,788,140.95
基金赎回款	-685,317.40	5,377,542.44	4,692,225.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,448,415.09	-8,173,731.47	-16,622,146.56

##### 融通核心价值混合（QDII）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,555,544.54	-8,545,361.15	10,183.39
本期利润	-316,849.63	54,622.35	-262,227.28
本期基金份额交易产生的变动数	37,367,560.28	-37,574,790.58	-207,230.30
其中：基金申购款	92,819,286.35	-93,448,774.58	-629,488.23
基金赎回款	-55,451,726.07	55,873,984.00	422,257.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,606,255.19	-46,065,529.38	-459,274.19

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	141,686.28	27,296.68
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	-	-
其他	-	188.89

合计	141,686.28	27,485.57
----	------------	-----------

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-23,706,572.96	-9,979,492.54
股票投资收益——赎回差价 收入	-	-
股票投资收益——申购差价 收入	-	-
股票投资收益——证券出借 差价收入	-	-
合计	-23,706,572.96	-9,979,492.54

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出股票成交总额	205,923,821.73	336,186,742.32
减：卖出股票成本总额	229,044,365.35	346,166,234.86
减：交易费用	586,029.34	-
买卖股票差价收入	-23,706,572.96	-9,979,492.54

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出/赎回基金成交总额	10,361,899.29	5,186,319.85
减：卖出/赎回基金成本总额	9,951,908.87	5,223,962.20
减：买卖基金差价收入应缴 纳增值税额	11,941.47	-
减：交易费用	7,265.35	-
基金投资收益	390,783.60	-37,642.35

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,115,753.45	2,062,979.56
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	3,453.08
合计	2,115,753.45	2,066,432.64

## 7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
1. 交易性金融资产	-744,135.43	-2,741,875.00
股票投资	-744,135.43	-2,741,875.00
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-744,135.43	-2,741,875.00

## 7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
基金赎回费收入	49,006.47	681,840.94
合计	49,006.47	681,840.94

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

## 7.4.7.23 信用减值损失

无。

## 7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	35,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	145.00	135.00
其他	-	2,651.05
交易费用	-	862,685.51
合计	115,145.00	945,471.56

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
诚通证券股份有限公司（“诚通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本管理股份有限公司（“融通资本”）	本基金管理人能实施重大影响的联营企业
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 2022年4月13日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告》，中国证券监督管理委员会于2022年3月24日依法核准了中国诚通控股集团有限公司成为新时代证券股份有限公司主要股东、融通基金管理有限公司实际控制人。本次变更完成后，本基金管理人控股股东为新时代证券股份有限公司保持不变，本基金管理人实际控制人变更为中国诚通控股集团有限公司。2022年6月2日，本基金管理人控股股东的公司名称由“新时代证券股份有限公司”变更为“诚通证券股份有限公司”。

3. 融通资本为融通基金持有52.575%股权比例的基金管理公司子公司。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

无。

## 7.4.10.1.2 债券交易

无。

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

## 7.4.10.1.4 基金交易

无。

## 7.4.10.1.5 权证交易

无。

## 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	939,234.08	1,534,614.12
其中：支付销售机构的客户维护费	375,834.70	595,814.88

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

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

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

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	156,538.85	255,769.00

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐

日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

#### 7.4.10.2.3 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通核心价值混合（QDII）A	融通核心价值混合（QDII）C	合计
融通基金	-	206.08	206.08
合计	-	206.08	206.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通核心价值混合（QDII）A	融通核心价值混合（QDII）C	合计
融通基金	-	6.96	6.96
合计	-	6.96	6.96

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

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,104,904.49	13,962.50	6,306,589.23	27,413.04
布朗兄弟哈里曼银行	17,361,444.82	127,723.78	33,999,370.26	-116.36

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金主要投资于境外股票、基金和债券。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性

风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

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

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

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

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

并报告法规和制度的执行情况。

#### 7.4.13.2 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境内托管人中国工商银行以及境外次托管人布朗兄弟哈里曼银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 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 2022 年 12 月 31 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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 12 月 31 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,466,349.31	-	-	-	19,466,349.31
交易性金融资产	-	-	-	34,359,781.53	34,359,781.53
应收股利	-	-	-	12,019.84	12,019.84
应收申购款	-	-	-	133,483.05	133,483.05
资产总计	19,466,349.31	-	-	34,505,284.42	53,971,633.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	298,694.86	298,694.86
应付管理人报酬	-	-	-	68,259.90	68,259.90
应付托管费	-	-	-	11,376.64	11,376.64
应付清算款	-	-	-	902,961.33	902,961.33
应付销售服务费	-	-	-	569.62	569.62
应交税费	-	-	-	9,000.06	9,000.06
其他负债	-	-	-	115,518.52	115,518.52
负债总计	-	-	-	1,406,380.93	1,406,380.93
利率敏感度缺口	19,466,349.31	-	-	33,098,903.49	52,565,252.80
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	40,305,959.49	-	-	-	40,305,959.49
交易性金融资产	-	-	-	59,184,772.70	59,184,772.70
应收股利	-	-	-	8,462.16	8,462.16
应收申购款	-	-	-	197,518.22	197,518.22
其他资产	-	-	-	529.41	529.41
资产总计	40,305,959.49	-	-	59,391,282.49	99,697,241.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	763,354.21	763,354.21
应付管理人报酬	-	-	-	112,564.76	112,564.76
应付托管费	-	-	-	18,760.82	18,760.82
应付证券清算款	-	-	-	12,379,747.27	12,379,747.27
应付销售服务费	-	-	-	84.42	84.42
其他负债	-	-	-	82,193.11	82,193.11
负债总计	-	-	-	13,356,704.59	13,356,704.59
利率敏感度缺口	40,305,959.49	-	-	46,034,577.90	86,340,537.39

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种折合 人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	10,631,180.74	6,730,359.04	-	17,361,539.78
交易性金融资产	2,465,352.86	31,894,428.67	-	34,359,781.53
应收股利	-	12,019.84	-	12,019.84
资产合计	13,096,533.60	38,636,807.55	-	51,733,341.15
以外币计价的负债				
应付清算款	-	902,961.33	-	902,961.33
负债合计	-	902,961.33	-	902,961.33
资产负债表外汇风险敞口 净额	13,096,533.60	37,733,846.22	-	50,830,379.82
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	15,000,316.29	18,999,140.21	-	33,999,456.50
交易性金融资产	37,711,906.80	21,472,865.90	-	59,184,772.70
应收股利	-	8,462.16	-	8,462.16
资产合计	52,712,223.09	40,480,468.27	-	93,192,691.36
以外币计价的负债				
应付清算款	2,414,610.84	9,965,136.43	-	12,379,747.27
负债合计	2,414,610.84	9,965,136.43	-	12,379,747.27
资产负债表外汇风险敞口 净额	50,297,612.25	30,515,331.84	-	80,812,944.09

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

	影响金额（单位：人民币元）	
	本期末 （2022 年 12 月 31 日）	上年度末 （2021 年 12 月 31 日）
所有外币相对人民币升值 5%	2,541,518.99	4,040,647.20
所有外币相对人民币贬值 5%	-2,541,518.99	-4,040,647.20

#### 7.4.13.4.3 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，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投资占基金资产的比例不超过 80%，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%，本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	34,359,781.53	65.37	59,184,772.70	68.55
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	34,359,781.53	65.37	59,184,772.70	68.55

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除恒生指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2022 年 12 月 31 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	恒生指数收益率上升 5%	856,806.80	2,684,206.25
	恒生指数收益率下降 5%	-856,806.80	-2,684,206.25

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 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。

## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	34,359,781.53	59,184,772.70
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	34,359,781.53	59,184,772.70

## 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;对于定期开放的基金投资,本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。



## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：同）。

## 7.4.14.4 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。

## 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	34,359,781.53	63.66
	其中：普通股	33,396,354.83	61.88
	存托凭证	963,426.70	1.79
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,466,349.31	36.07
8	其他各项资产	145,502.89	0.27
9	合计	53,971,633.73	100.00

## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
--------	------	---------------

中国香港	31,894,428.67	60.68
美国	2,465,352.86	4.69
合计	34,359,781.53	65.37

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
能源	-	-
原材料	-	-
工业	7,060,674.07	13.43
非日常生活消费品	12,367,206.87	23.53
日常消费品	-	-
医疗保健	2,750,807.10	5.23
金融	2,498,636.25	4.75
信息技术	-	-
通信服务	559,222.75	1.06
公用事业	1,074,550.21	2.04
房地产	8,048,684.28	15.31
合计	34,359,781.53	65.37

注：以上分类采用国际通用的行业分类标准。

### 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	阿里巴巴	9988 HK	香港联合交易所	中国香港	34,400	2,650,332.09	5.04
2	SANDS CHINA LTD	金沙中国	1928 HK	香港联合交易所	中国香港	92,400	2,137,738.03	4.07
3	EC HEALTHCARE	医思健康	2138 HK	香港联合交易所	中国香港	232,000	1,664,126.28	3.17
4	MTR CORP	港铁公司	66 HK	香港联合交易所	中国香港	44,000	1,625,215.44	3.09
5	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	九龙仓置业	1997 HK	香港联合交易所	中国香港	38,000	1,544,463.83	2.94
6	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港联合交易所	中国香港	19,800	1,535,209.55	2.92
7	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	国泰航空	293 HK	香港联合交易所	中国香港	200,000	1,522,132.08	2.90
8	YUM CHINA HOLDINGS INC	百胜中国	9987 HK	香港联合交易所	中国香港	3,850	1,509,760.29	2.87

9	JD.COM INC-ADR	京东集团	JD US	美国证券交易所	美国	3,842	1,501,926.16	2.86
10	SIMCERE PHARMACEUTICAL GROUP	先声药业	2096 HK	香港联合交易所	中国香港	144,000	1,494,690.83	2.84
11	HAINAN MEILAN INTERNATIONAL-H	美兰空港	357 HK	香港联合交易所	中国香港	70,000	1,485,061.38	2.83
12	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	碧桂园服务	6098 HK	香港联合交易所	中国香港	85,000	1,476,039.35	2.81
13	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	1109 HK	香港联合交易所	中国香港	46,000	1,468,982.52	2.79
14	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	莎莎国际	178 HK	香港联合交易所	中国香港	898,000	1,459,924.76	2.78
15	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	新濠国际发展	200 HK	香港联合交易所	中国香港	191,000	1,443,399.26	2.75
16	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国海外发展	688 HK	香港联合交易所	中国香港	77,000	1,416,904.87	2.70
17	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	中国南方航空股份	1055 HK	香港联合交易所	中国香港	280,000	1,270,587.25	2.42
18	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	华润医药	3320 HK	香港联合交易所	中国香港	222,500	1,256,116.27	2.39
19	GREENTOWN MANAGEMENT HOLDING	绿城管理控股	9979 HK	香港联合交易所	中国香港	216,000	1,157,677.92	2.20
20	SEAZEN GROUP LTD	新城发展	1030 HK	香港联合交易所	中国香港	434,000	1,120,392.83	2.13
21	HUANENG POWER INTL INC-H	华能国际电力股份	902 HK	香港联合交易所	中国香港	326,000	1,074,550.21	2.04
22	NEW WORLD DEVELOPMENT	新世界发展	17 HK	香港联合交易所	中国香港	52,000	1,021,900.88	1.94
23	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	富途控股有限公司	FUTU US	美国证券交易所	美国	3,403	963,426.70	1.83
24	IMAX CHINA HOLDING INC	IMAX 中国控股	1970 HK	香港联合交易所	中国香港	88,800	559,222.75	1.06

注：本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CNOOC LTD	883 HK	11,060,843.16	12.81

2	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	6,336,688.37	7.34
3	TESLA INC	TSLA US	5,933,790.33	6.87
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	5,419,253.39	6.28
5	NETEASE INC	9999 HK	5,204,809.51	6.03
6	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	5,138,386.09	5.95
7	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	4,821,941.34	5.58
8	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	4,704,130.37	5.45
9	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	4,662,222.99	5.40
10	CHINA MOBILE LTD	941 HK	4,637,047.39	5.37
11	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1800 HK	4,031,556.77	4.67
12	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	1787 HK	3,763,926.39	4.36
13	XPENG INC - CLASS A SHARES	9868 HK	3,736,076.27	4.33
14	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	3,549,379.06	4.11
15	TRIP.COM GROUP LTD	9961 HK	3,143,856.19	3.64
16	YUM CHINA HOLDINGS INC	9987 HK	3,078,410.72	3.57
17	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	3,045,641.38	3.53
18	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	1877 HK	3,024,607.20	3.50
19	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	3,014,216.88	3.49
20	COSCO SHIPPING-H Equity	1919 HK	3,008,186.22	3.48
21	SIMCERE PHARMACEUTICAL GROUP	2096 HK	2,956,124.21	3.42
22	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	2343 HK	2,904,250.87	3.36
23	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	293 HK	2,754,901.55	3.19
24	HAINAN MEILAN INTERNATIONAL-H	357 HK	2,752,074.81	3.19
25	BUNGE LTD	BG US	2,545,216.14	2.95
26	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	2,532,464.29	2.93
27	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	1138 HK	2,514,677.11	2.91
28	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM US	2,497,574.36	2.89
29	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	2,380,169.25	2.76
30	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	2,379,631.66	2.76
31	JD.COM INC - CL A	9618 HK	2,352,041.78	2.72
32	LI AUTO INC-CLASS A	2015 HK	2,271,894.04	2.63
33	SANDS CHINA LTD	1928 HK	2,150,158.28	2.49
34	COFCO JOYCOME FOODS LTD	1610 HK	2,115,566.46	2.45
35	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	817 HK	2,101,924.37	2.43
36	NIO INC-CLASS A	9866 HK	2,055,115.51	2.38
37	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	2,003,283.19	2.32
38	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS	81 HK	1,965,853.05	2.28
39	BAIDU INC-CLASS A	9888 HK	1,928,588.39	2.23
40	EVA PRECISION INDUSTRIAL HLD	838 HK	1,892,009.42	2.19
41	BILIBILI INC-CLASS Z	9626 HK	1,890,345.14	2.19
42	YUEXIU PROPERTY CO LTD	123 HK	1,869,330.63	2.17
43	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	1,818,999.67	2.11
44	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	1,805,381.00	2.09

45	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	1,801,908.16	2.09
46	CATERPILLAR INC	CAT US	1,798,617.46	2.08
47	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	1171 HK	1,791,197.66	2.07
48	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	1,766,016.48	2.05
49	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	1,762,429.28	2.04
50	MEITUAN DIANPING-B	3690 HK	1,761,962.62	2.04

注：1、本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

2、“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CNOOC LTD	883 HK	11,160,582.26	12.93
2	TESLA INC	TSLA US	10,127,068.27	11.73
3	APPLE INC	AAPL US	6,833,930.04	7.92
4	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	6,073,969.91	7.03
5	NVIDIA CORP	NVDA US	5,282,977.48	6.12
6	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2388 HK	5,040,522.43	5.84
7	NETEASE INC	9999 HK	4,823,098.22	5.59
8	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	4,763,806.54	5.52
9	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	4,746,812.28	5.50
10	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	4,573,142.16	5.30
11	BYD CO LTD-H	1211 HK	4,526,049.60	5.24
12	CHINA MOBILE LTD	941 HK	4,438,600.10	5.14
13	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	4,014,653.76	4.65
14	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	1787 HK	3,856,961.78	4.47
15	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	3,856,041.28	4.47
16	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	1877 HK	3,699,180.92	4.28
17	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1800 HK	3,658,249.97	4.24
18	L. K. TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	558 HK	3,575,502.90	4.14
19	XPENG INC - ADR	XPEV US	3,392,144.67	3.93
20	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	3,274,466.63	3.79
21	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	3,216,116.91	3.72
22	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	3,039,194.81	3.52
23	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	2343 HK	2,993,166.47	3.47
24	TRIP.COM GROUP LTD	9961 HK	2,915,468.94	3.38
25	COSCO SHIPPING-H Equity	1919 HK	2,624,509.56	3.04
26	FACEBOOK INC-A	FB US	2,557,536.70	2.96
27	JD.COM INC - CL A	9618 HK	2,518,867.57	2.92
28	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	2,515,136.40	2.91
29	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	1138 HK	2,477,591.63	2.87
30	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	2,461,422.56	2.85

31	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	ADM US	2,459,327.22	2.85
32	LUMINAR TECHNOLOGIES INC	LAZR US	2,389,142.03	2.77
33	BUNGE LTD	BG US	2,258,270.77	2.62
34	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	3311 HK	2,219,480.45	2.57
35	UNITY SOFTWARE INC	U US	2,093,611.33	2.42
36	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	2,091,743.84	2.42
37	COFCO JOYCOME FOODS LTD	1610 HK	2,083,652.41	2.41
38	SCORPIO TANKERS INC	STNG US	2,000,478.28	2.32
39	YUEXIU PROPERTY CO LTD	123 HK	1,968,064.05	2.28
40	CATERPILLAR INC	CAT US	1,889,756.17	2.19
41	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	1385 HK	1,879,174.44	2.18
42	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	836 HK	1,868,426.56	2.16
43	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	1,855,110.60	2.15
44	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	1,850,388.12	2.14
45	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	1,839,020.44	2.13
46	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	1171 HK	1,822,457.18	2.11
47	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	1,814,379.94	2.10
48	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	1,800,419.40	2.09

注：1、本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

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

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	204,838,214.77
卖出收入（成交）总额	205,923,821.73

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

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

## 8.11 投资组合报告附注

## 8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

## 8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

## 8.11.3 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	12,019.84
4	应收利息	-
5	应收申购款	133,483.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	145,502.89

## 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
融通核心价值混合（QDII）A	15,983	4,242.62	-	-	67,809,784.37	100.00
融通核心价值混合	673	2,729.40	-	-	1,836,889.18	100.00

(QDII) C						
合计	16,656	4,181.48	-	-	69,646,673.55	100.00

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通核心价值混合（QDII）A	6,901.75	0.01018
	融通核心价值混合（QDII）C	51,532.72	2.80543
	合计	58,434.47	0.08390

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通核心价值混合（QDII）A	0
	融通核心价值混合（QDII）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通核心价值混合（QDII）A	0
	融通核心价值混合（QDII）C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通核心价值混合（QDII）A	融通核心价值混合（QDII）C
基金合同生效日(2019年1月4日)基金份额总额	19,839,642.93	-
本报告期期初基金份额总额	83,466,653.91	340,786.75
本报告期基金总申购份额	18,840,467.66	3,722,209.15
减：本报告期基金总赎回份额	34,497,337.20	2,226,106.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	67,809,784.37	1,836,889.18

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

1、2022年5月30日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本基金管理人董事长由高峰变更为张威，上述变更事项经本基金管理人股东会2022年第一次临时会议、第六届董事会第十九次临时会议审议并通过。

2、2022年7月，经本基金管理人股东会表决通过，股东诚通证券股份有限公司提名的罗林



先生、罗小平先生任公司董事，股东日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd）提名的吕秋梅女士任公司董事；宗文龙先生、李曙光先生、席德应先生任公司独立董事。王利先生、律磊先生、大柳雄二（Yuji Ooyagi）先生不再担任公司董事；杜婕女士、施天涛先生、田利辉先生不再担任公司独立董事。

3、2022 年 12 月 24 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本公司副总经理由 Allen Yan（颜锡廉）变更为江涛，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为人民币 35,000.00 元。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

##### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
CLSA	-	129,715,450.29	31.58	39,769.26	28.80	-
HTSC	-	121,434,506.26	29.56	37,718.76	27.31	-

大和资本	-	84,890,606.91	20.67	28,010.76	20.28	-
CICC	-	48,974,128.02	11.92	24,186.62	17.51	-
Macquarie	-	21,679,589.50	5.28	6,503.87	4.71	-
CMS	-	4,067,755.52	0.99	1,905.60	1.38	-
CITI	-	-	-	-	-	-
EVERBRIGHT	-	-	-	-	-	-
GFSC	-	-	-	-	-	-
GTJA	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-
ICBCI	-	-	-	-	-	-
JPMorgan	-	-	-	-	-	-
Morganstanley	-	-	-	-	-	-
海通国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、针对境外投资业务涉及多个海外证券市场金融产品的投资特点，在对券商的选择上，着重考察以下因素：

- （1）在全球范围内研究的综合实力；
- （2）在单个国家（地区）证券市场的特色研究力量；
- （3）在全球主要证券交易市场进行交易的便捷性和高效性。

2、券商选择的流程如下：

（1）针对券商等级评分，由国际业务部提出券商候选名单，风险管理部进行尽职调查，并提出评估报告；

（2）组合经理和交易员根据券商研究服务品质、交易执行能力等因素，定期对往来下单券商进行综合评分；

（3）评分记录归档并送国际业务部备案。

3、交易单元变更情况

无。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

		额的比例 (%)		比例 (%)		额的比例 (%)		额的比例 (%)
CLSA	-	-	-	-	-	-	2,848,715.82	14.02
HTSC	-	-	-	-	-	-	4,294,743.22	21.14
大和资本	-	-	-	-	-	-	8,477,888.50	41.73
CICC	-	-	-	-	-	-	4,692,460.63	23.10
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
CMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI	-	-	-	-	-	-	-	-
EVERBRIGHT	-	-	-	-	-	-	-	-
GFSC	-	-	-	-	-	-	-	-
GTJA	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBCI	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan	-	-	-	-	-	-	-	-
Morganstanley	-	-	-	-	-	-	-	-
海通国际	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-1-1
2	融通关于旗下部分开放式基金参加宁波银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-1-25
3	融通基金管理有限公司关于参加平安证券股份有限公司前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-2-21
4	关于旗下部分开放式基金新增申万宏源西部证券有限公司为销售机构并开通定期定额申购、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-3-7
5	融通关于旗下部分开放式基金新增北京中植基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-4-6
6	融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-4-13
7	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-5-30
8	融通基金管理有限公司关于公司股东名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-6-10
9	融通基金管理有限公司关于公司董事变更情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-7-16

10	融通基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-7-27
11	关于旗下部分开放式基金新增销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-8-10
12	关于旗下部分开放式基金新增兴业银行股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-8-24
13	关于旗下部分开放式基金新增销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-9-26
14	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的停牌股票估值方法调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-11-2
15	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-11-25
16	融通基金管理有限公司关于基金经理申购旗下基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-16
17	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-24
18	融通关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行 2023 年全年个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-30
19	融通基金管理有限公司旗下部分证券投资基金关于 2023 年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-30
20	融通关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司“2023 倾心回馈”基金定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-30

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2022 年 4 月 13 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告》，中国证券监督管理委员会于 2022 年 3 月 24 日依法核准了中国诚通控股集团有限公司成为新时代证券股份有限公司主要股东、融通基金管理有限公司实际控制人。本次变更完成后，本基金管理人控股股东为新时代证券股份有限公司保持不变，本基金管理人实际控制人变更为中国诚通控股集团有限公司。2022 年 6 月 2 日，本基金管理人控股股东的公司名称由“新时代证券股份有限公司”变更为“诚通证券股份有限公司”。

2、2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变

更的公告》，本公司首席信息官由 Allen Yan（颜锡廉）变更为高翔，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

3、2023 年 3 月 14 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任杜国彦为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

（一）《融通基金管理有限公司关于以通讯方式召开融通丰利四分法证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》

（二）《融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金合同》

（三）《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)托管协议》

（四）《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)招募说明书》及其更新

（五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

（六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日