

融通核心价值混合型
证券投资基金（QDII）
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国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 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	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	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37

7.3 期末按行业分类的权益投资组合	37
7.4 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	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
7.7 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	41
7.8 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	41
7.9 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	41
7.10 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	41
7.11 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 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	67,093,359.29 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	65,162,724.36 份	1,930,634.93 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
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
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 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区复兴门内大街 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	融通核心价值混合（QDII）A	融通核心价值混合（QDII）C
本期已实现收益	-3,337,689.68	-100,048.26
本期利润	-816,470.92	-39,926.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0122	-0.0179
本期加权平均净值利润率	-1.67%	-2.46%
本期基金份额净值增长率	-1.56%	-1.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-16,739,587.41	-509,272.87
期末可供分配基金份额利润	-0.2569	-0.2638
期末基金资产净值	48,423,136.95	1,421,362.06
期末基金份额净值	0.7431	0.7362
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

基金份额累计净值增长率	4.81%	-30.16%
-------------	-------	---------

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通核心价值混合（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
过去一个月	6.95%	0.92%	4.15%	0.96%	2.80%	-0.04%
过去三个月	1.05%	0.94%	-1.28%	0.84%	2.33%	0.10%
过去六个月	-1.56%	1.12%	-0.33%	0.93%	-1.23%	0.19%
过去一年	-11.82%	1.09%	-3.71%	1.14%	-8.11%	-0.05%
过去三年	-18.48%	1.21%	-13.58%	1.06%	-4.90%	0.15%
自基金合同生效起至今	4.81%	1.12%	-11.52%	1.01%	16.33%	0.11%

融通核心价值混合（QDII）C

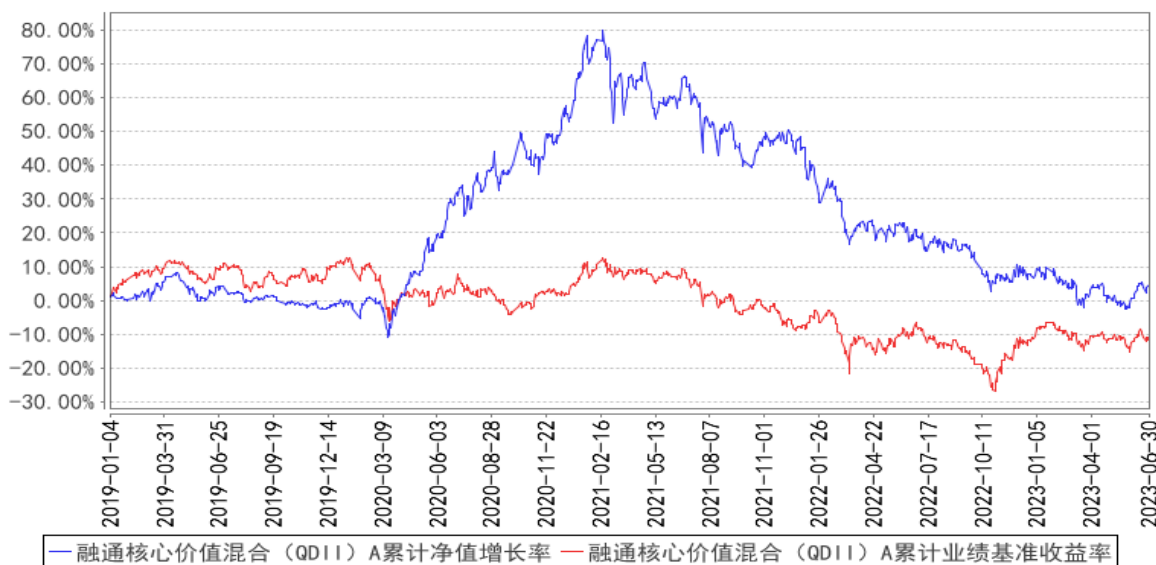
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.91%	0.92%	4.15%	0.96%	2.76%	-0.04%
过去三个月	0.92%	0.94%	-1.28%	0.84%	2.20%	0.10%
过去六个月	-1.84%	1.12%	-0.33%	0.93%	-1.51%	0.19%
过去一年	-12.28%	1.09%	-3.71%	1.14%	-8.57%	-0.05%
自基金合同生效起	-30.16%	1.10%	-8.91%	1.22%	-21.25%	-0.12%

至今						%
----	--	--	--	--	--	---

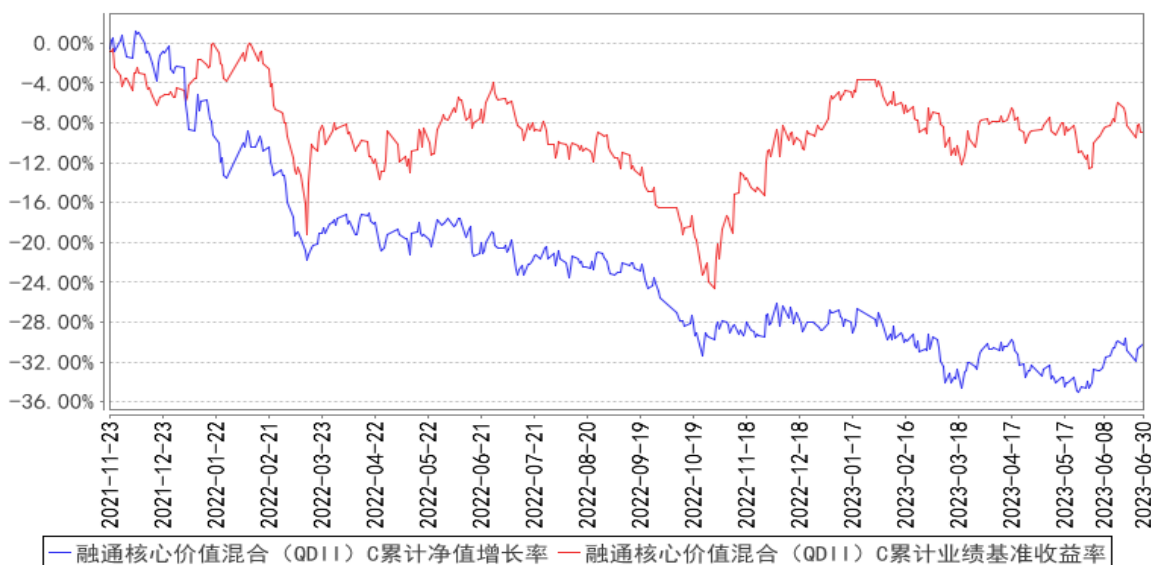
注：同期业绩比较基准以人民币计价。

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。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张婷	本基金的基金经理	2019/1/12	-	11	张婷女士，悉尼大学会计硕士，11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、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，现任融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年报告期内，核心价值基金秉持着稳健的投资策略，通过深入研究和分析市场走势，选取高质量的成长性公司进行投资。在持仓方面，基金主要投资于科技和能源行业。科技行业一直被视为未来经济增长的引擎，核心价值基金抓住了这一机遇，积极配置了科技领域的优质公司。在上半年，基金通过对科技公司的深入研究，选取了一些具备高成长性和潜力的科技公司进行投资。这些公司在人工智能、云计算、大数据等领域具备核心竞争力，有望在未来取得良好的业绩表现。另外，能源行业也是核心价值基金的重点关注领域之一。在上半年，基金通过对能源公司的细致分析和评估，选取了一些具备优质资产和稳定现金流的能源公司进行投资。这些公司在油气勘探、可再生能源等领域具有竞争优势，有望在能源行业的复苏和转型中获得可观的回报。核心价值基金在上半年取得了稳健的表现。我们力争通过稳健的投资策略使基金在市场波动中保持较低的风险水平。

4.5.2 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 0.7431 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.33%；

截至本报告期末融通核心价值混合（QDII）C 基金份额净值为 0.7362 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.84%，同期业绩比较基准收益率为-0.33%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国经济将继续保持稳定增长的势头，政府的宏观调控政策将继续支持经济发

展。港股市场作为一个国际化的金融中心，将继续受益于中国经济的增长和资本市场改革的推进。随着美国加息接近尾声，流动性的逐步改善，相信下半年市场对港股的关注度也将增加，香港股票在第三季度会有相对吸引的窗口期。我们认为下半年人工智能领域将继续是投资的热点。中国在人工智能领域取得了显著进展，政府也将继续支持该领域的发展。美国作为全球科技创新的领导者，其科技企业在人工智能领域也将继续保持竞争优势。因此，人工智能相关的公司有望获得更多的投资机会。基于以上展望，融通核心价值混合基金将继续关注科技行业，特别是人工智能领域的投资机会。我们将寻找那些具有创新能力、技术优势和良好商业模式的公司，以期获得长期的投资回报。同时，我们也将密切关注宏观经济和市场变化，及时调整投资策略，以确保基金的稳健运作。

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、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，符合法律法规和基金合同的规定。

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

从 2023 年 4 月 21 日至 2023 年 6 月 13 日，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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的真实、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 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	20,268,657.75	19,466,349.31
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	42,625,796.48	34,359,781.53
其中：股票投资		38,896,518.67	34,359,781.53
基金投资		3,729,277.81	-
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	-	-

债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		85,570.11	12,019.84
应收申购款		31,895.28	133,483.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		63,011,919.62	53,971,633.73
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		12,514,097.49	902,961.33
应付赎回款		526,228.18	298,694.86
应付管理人报酬		60,981.96	68,259.90
应付托管费		10,163.64	11,376.64
应付销售服务费		615.29	569.62
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	6.4.7.9	55,334.05	115,518.52
负债合计		13,167,420.61	1,406,380.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	67,093,359.29	69,646,673.55
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-17,248,860.28	-17,081,420.75
净资产合计		49,844,499.01	52,565,252.80
负债和净资产总计		63,011,919.62	53,971,633.73

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 67,093,359.29 份，其中融通核心价值混合（QDII）A 类基金份额 65,162,724.36 份，基金份额净值 0.7431 元；融通核心价值混合（QDII）C 类基金份额 1,930,634.93 份，基金份额净值 0.7362 元。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-357,140.82	-14,355,501.26
1. 利息收入		128,666.12	10,955.60
其中：存款利息收入	6.4.7.13	128,666.12	10,955.60
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		-3,652,511.38	-12,976,355.69
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,842,672.94	-14,810,912.58
基金投资收益	6.4.7.15	-1,511.56	124,550.20
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	191,673.12	1,710,006.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益	6.4.7.21	2,581,340.58	-2,064,545.24
4. 汇兑收益		573,558.35	640,395.73
5. 其他收入	6.4.7.22	11,805.51	34,048.34
减：二、营业总支出		499,256.54	654,177.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	377,669.00	509,914.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	62,944.87	84,985.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,009.70	1,700.57
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	468.68
8. 其他费用	6.4.7.24	54,632.97	57,107.67
三、利润总额		-856,397.36	-15,009,678.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-856,397.36	-15,009,678.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-856,397.36	-15,009,678.49

6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	69,646,673.55	-	-17,081,420.75	52,565,252.80
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）	69,646,673.55	-	-17,081,420.75	52,565,252.80
三、本期增减变动额	-2,553,314.26	-	-167,439.53	-2,720,753.79
（一）、综合收益总额	-	-	-856,397.36	-856,397.36
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,553,314.26	-	688,957.83	-1,864,356.43
其中：1. 基金申购款	9,584,815.07	-	-2,543,948.37	7,040,866.70
2. 基金赎回款	-12,138,129.33	-	3,232,906.20	-8,905,223.13
（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）	67,093,359.29	-	-17,248,860.28	49,844,499.01
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	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	-10,897,823.38	-	-14,006,712.67	-24,904,536.05
（一）、综合收益总额	-	-	-15,009,678.49	-15,009,678.49
（二）、本期基金份额	-10,897,823.38	-	1,002,965.82	-9,894,857.56

交易产生的基金净值变动数				
其中：1. 基金申购款	12,642,857.60	-	-1,386,321.66	11,256,535.94
2. 基金赎回款	-23,540,680.98	-	2,389,287.48	-21,151,393.50
（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）	72,909,617.28	-	-11,473,615.94	61,436,001.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张帆

高翔

刘美丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 附注

6.4.1 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 ExchangeTradedFund,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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以

及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2023 年 6 月 30 日
活期存款	20,268,657.75
等于：本金	20,268,452.05
加：应计利息	205.70
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	20,268,657.75

注：于 2023 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 2,199,986.85 元，美元活期存款 966,720.26 元（折合人民币 6,985,327.26 元），港币活期存款 12,021,240.85 元（折合人民币 11,083,343.64 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	37,483,259.44	-	38,896,518.67	1,413,259.23
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	3,926,094.32	-	3,729,277.81	-196,816.51
其他	-	-	-	-
合计	41,409,353.76	-	42,625,796.48	1,216,442.72

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	786.08
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	54,547.97
合计	55,334.05

6.4.7.10 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,809,784.37	67,809,784.37
本期申购	7,228,238.69	7,228,238.69
本期赎回（以“-”号填列）	-9,875,298.70	-9,875,298.70
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	65,162,724.36	65,162,724.36

融通核心价值混合（QDII）C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,836,889.18	1,836,889.18
本期申购	2,356,576.38	2,356,576.38
本期赎回（以“-”号填列）	-2,262,830.63	-2,262,830.63
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	1,930,634.93	1,930,634.93

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

融通核心价值混合（QDII）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,448,415.09	-8,173,731.47	-16,622,146.56
本期利润	-3,337,689.68	2,521,218.76	-816,470.92
本期基金份额交易产生的变动数	383,547.60	315,482.47	699,030.07
其中：基金申购款	-992,517.15	-928,676.51	-1,921,193.66
基金赎回款	1,376,064.75	1,244,158.98	2,620,223.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,402,557.17	-5,337,030.24	-16,739,587.41

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
上年度末	45,606,255.19	-46,065,529.38	-459,274.19
本期利润	-100,048.26	60,121.82	-39,926.44
本期基金份额交易产生的变动数	2,327,925.03	-2,337,997.27	-10,072.24
其中：基金申购款	58,481,227.62	-59,103,982.33	-622,754.71
基金赎回款	-56,153,302.59	56,765,985.06	612,682.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,834,131.96	-48,343,404.83	-509,272.87

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	128,666.12
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	-
合计	128,666.12

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,842,672.94
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	-3,842,672.94

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	87,061,478.53
减：卖出股票成本总额	90,636,214.43
减：交易费用	267,937.04
买卖股票差价收入	-3,842,672.94

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	1,511.56
基金投资收益	-1,511.56

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	191,673.12
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	191,673.12

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,581,340.58
股票投资	2,778,157.09
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-196,816.51
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	2,581,340.58

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	11,805.51
合计	11,805.51

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。

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	85.00
合计	54,632.97

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	377,669.00	509,914.64
其中：支付销售机构的客户维护费	152,575.86	202,426.03

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	62,944.87	84,985.67

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：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通核心价值混合（QDII）A	融通核心价值混合（QDII）C	合计
融通基金	-	146.25	146.25
合计	-	146.25	146.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通核心价值混合（QDII）A	融通核心价值混合（QDII）C	合计
融通基金	-	67.38	67.38
合计	-	67.38	67.38

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	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	2,200,085.71	4,494.11	2,736,072.53	7,977.45
布朗兄弟哈里曼银行	18,068,572.04	124,172.01	15,610,070.33	2,978.15

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的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割和款项清算，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 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,268,657.75	-	-	-	20,268,657.75
交易性金融资产	-	-	-	42,625,796.48	42,625,796.48
应收股利	-	-	-	85,570.11	85,570.11
应收申购款	-	-	-	31,895.28	31,895.28
资产总计	20,268,657.75	-	-	42,743,261.87	63,011,919.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	526,228.18	526,228.18
应付管理人报酬	-	-	-	60,981.96	60,981.96
应付托管费	-	-	-	10,163.64	10,163.64
应付清算款	-	-	-	12,514,097.49	12,514,097.49
应付销售服务费	-	-	-	615.29	615.29
其他负债	-	-	-	55,334.05	55,334.05
负债总计	-	-	-	13,167,420.61	13,167,420.61
利率敏感度缺口	20,268,657.75	-	-	29,575,841.26	49,844,499.01
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,466,349.31	-	-	-	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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	6,985,327.26	11,083,343.64	-	18,068,670.90
交易性金融资产	22,146,737.45	20,479,059.03	-	42,625,796.48
应收股利	-	84,750.11	-	84,750.11
资产合计	29,132,064.71	31,647,152.78	-	60,779,217.49
以外币计价的负债				
应付清算款	4,407,542.90	8,106,554.59	-	12,514,097.49
负债合计	4,407,542.90	8,106,554.59	-	12,514,097.49
资产负债表外汇风险敞口净额	24,724,521.81	23,540,598.19	-	48,265,120.00
项目	上年度末 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
---------------	---------------	---------------	---	---------------

6.4.13.4.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	2,413,256.00	2,541,518.99
所有外币相对人民币贬值 5%	-2,413,256.00	-2,541,518.99	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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净资产的 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，不得超过基金净资产的 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	38,896,518.67	78.04	34,359,781.53	65.37
交易性金融资产—基金投资	3,729,277.81	7.48	-	-

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	42,625,796.48	85.52	34,359,781.53	65.37

6.4.13.4.3.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	恒生指数收益率上升5%	1,605,352.69	856,806.80
	恒生指数收益率下降5%	-1,605,352.69	-856,806.80

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	42,625,796.48	34,359,781.53
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	42,625,796.48	34,359,781.53

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的

交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日:同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	38,896,518.67	61.73
	其中:普通股	37,025,232.44	58.76
	存托凭证	1,871,286.23	2.97
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	3,729,277.81	5.92
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	20,268,657.75	32.17
8	其他各项资产	117,465.39	0.19
9	合计	63,011,919.62	100.00

7.2 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（%）
美国	22,146,737.45	44.43
中国香港	16,749,781.22	33.60
合计	38,896,518.67	78.04

7.3 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（%）
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	7,453,185.28	14.95
必需消费品	-	-
医疗保健	694,324.70	1.39
金融	-	-
科技	22,231,897.77	44.60
通讯	8,517,110.92	17.09
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	38,896,518.67	78.04

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

7.4 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	TESLA INC	特斯拉	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,192	4,146,162.88	8.32
2	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	1,249	3,817,765.74	7.66
3	ZTE CORP-H	中兴通讯	763 HK	香港联合交易所	中国香港	107,200	3,103,458.44	6.23
4	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	1,190	2,928,201.98	5.87
5	KINGSOFT CORP LTD	金山软件	3888 HK	香港联合交易所	中国香港	95,800	2,724,847.35	5.47
6	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港联合交易所	中国香港	38,500	2,273,533.53	4.56

7	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	1,804	1,484,855.94	2.98
8	BROADCOM INC	博通股份	AVGO US	纳斯达克证券交易所	美国	232	1,454,147.16	2.92
9	ALPHABET INC-CL A	ALPHABET 公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,568	1,356,207.51	2.72
10	MARVELL TECHNOLOGY INC	美满电子	MRVL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,103	1,340,366.68	2.69
11	SNOWFLAKE INC-CLASS A	Snowflake 公司	SNOW US	纽约证券交易所	美国	1,000	1,271,596.28	2.55
12	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD	金山云控股	3896 HK	香港联合交易所	中国香港	426,000	1,260,770.77	2.53
13	DATADOG INC - CLASS A	Datadog 公司	DDOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,762	1,252,560.35	2.51
14	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	台积电	TSM US	纽约证券交易所	美国	1,690	1,232,394.87	2.47
15	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	873	1,223,586.70	2.45
16	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	TCL 电子	1070 HK	香港联合交易所	中国香港	326,000	1,223,301.50	2.45
17	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港联合交易所	中国香港	3,900	1,192,341.42	2.39
18	CHINA LITERATURE LTD	阅文集团	772 HK	香港联合交易所	中国香港	38,600	1,172,638.70	2.35
19	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	5,000	1,152,475.00	2.31
20	XPENG INC - CLASS A SHARES	小鹏汽车	9868 HK	香港联合交易所	中国香港	21,300	981,908.70	1.97
21	MEITU INC	美图公司	1357 HK	香港联合交易所	中国香港	355,500	970,181.11	1.95

22	DINGDANG HEALTH TECHNOLOG Y G	叮当健 康	9886 HK	香港联合交 易所	中 国 香 港	268,000	694,324.70	1.39
23	YOUDAO INC - ADR	网易有 道	DAO US	纽约证券交 易所	美 国	18,344	638,891.36	1.28

注：本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超期初基金资产净值 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	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	3,555,691.63	6.76
2	NVIDIA CORP	NVDA US	3,228,812.01	6.14
3	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,083,832.57	5.87
4	TESLA INC	TSLA US	2,987,066.74	5.68
5	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD	3896 HK	2,967,454.19	5.65
6	ZTE CORP-H	763 HK	2,642,330.25	5.03
7	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	2,494,484.59	4.75
8	MICROSOFT CORP	MSFT US	2,491,287.37	4.74
9	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	1787 HK	2,253,638.66	4.29
10	CHINA MOBILE LTD	941 HK	2,127,086.60	4.05
11	CNOOC LTD	883 HK	1,966,409.88	3.74
12	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	1,954,273.23	3.72
13	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	1,667,939.88	3.17
14	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	1,664,291.41	3.17
15	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	1,627,731.22	3.10
16	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	1,601,522.83	3.05
17	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	1,587,162.18	3.02
18	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	1,548,074.18	2.95
19	TRIP.COM GROUP LTD	9961 HK	1,546,392.22	2.94
20	ASCENTAGE PHARMA GROUP INTER	6855 HK	1,539,070.09	2.93
21	BAIDU INC-CLASS A	9888 HK	1,527,404.08	2.91
22	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	1,517,884.37	2.89
23	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	1171 HK	1,486,252.86	2.83
24	KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	1797 HK	1,478,438.48	2.81
25	WEIMOB INC	2013 HK	1,462,109.35	2.78
26	MARVELL TECHNOLOGY INC	MRVL US	1,404,806.72	2.67
27	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	1,362,257.08	2.59
28	BROADCOM INC	AVGO US	1,359,944.23	2.59
29	NETEASE INC	9999 HK	1,354,067.63	2.58
30	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	836 HK	1,337,913.81	2.55

31	HUANENG POWER INTL INC-H	902 HK	1,320,582.61	2.51
32	DINGDANG HEALTH TECHNOLOGY G	9886 HK	1,267,629.78	2.41
33	SNOWFLAKE INC-CLASS A	SNOW US	1,260,980.00	2.40
34	AKESO INC	9926 HK	1,260,321.48	2.40
35	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	1070 HK	1,248,321.79	2.37
36	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	TSM US	1,224,124.22	2.33
37	APPLE INC	AAPL US	1,208,951.85	2.30
38	CHINA LITERATURE LTD	772 HK	1,196,335.09	2.28
39	DATADOG INC - CLASS A	DDOG US	1,181,441.09	2.25
40	BYD CO LTD-H	1211 HK	1,148,787.08	2.19
41	DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-H	1072 HK	1,096,476.19	2.09

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。

7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	4,392,717.51	8.36
2	CHINA OILFIELD SERVICES-H	2883 HK	2,509,766.49	4.77
3	HUANENG POWER INTL INC-H	902 HK	2,466,261.97	4.69
4	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD	3896 HK	2,413,960.42	4.59
5	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	2,330,786.88	4.43
6	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	1787 HK	2,257,129.61	4.29
7	SANDS CHINA LTD	1928 HK	2,156,687.45	4.10
8	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	2,156,561.79	4.10
9	CNOOC LTD	883 HK	2,134,023.77	4.06
10	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	1,887,506.88	3.59
11	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	1,868,850.19	3.56
12	EC HEALTHCARE	2138 HK	1,858,004.76	3.53
13	ASCENTAGE PHARMA GROUP INTER	6855 HK	1,754,673.04	3.34
14	YUM CHINA HOLDINGS INC	9987 HK	1,640,531.18	3.12
15	MTR CORP	66 HK	1,585,121.55	3.02
16	JD.COM INC-ADR	JD US	1,574,845.41	3.00
17	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6618 HK	1,558,579.02	2.97
18	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1997 HK	1,529,282.64	2.91
19	AIA GROUP LTD	1299 HK	1,507,817.54	2.87
20	TRIP.COM GROUP LTD	9961 HK	1,491,997.10	2.84
21	SIMCERE PHARMACEUTICAL GROUP	2096 HK	1,487,185.92	2.83
22	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	688 HK	1,469,561.94	2.80
23	CHINA RESOURCES LAND LTD	1109 HK	1,460,101.82	2.78
24	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	1171 HK	1,458,005.47	2.77
25	KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	1797 HK	1,427,009.58	2.71

26	NETEASE INC	9999 HK	1,418,745.58	2.70
27	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	178 HK	1,417,823.64	2.70
28	MELCO INTERNATIONAL DEVELOP.	200 HK	1,378,745.19	2.62
29	HAINAN MEILAN INTERNATIONAL-H	357 HK	1,372,467.98	2.61
30	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	1,363,010.33	2.59
31	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	293 HK	1,312,626.80	2.50
32	BAIDU INC-CLASS A	9888 HK	1,291,571.68	2.46
33	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	836 HK	1,288,333.50	2.45
34	INSPUR INTERNATIONAL LTD	596 HK	1,271,050.38	2.42
35	WEIMOB INC	2013 HK	1,269,509.21	2.42
36	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1055 HK	1,258,672.80	2.39
37	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	1,230,669.86	2.34
38	NEW HORIZON HEALTH LTD	6606 HK	1,158,052.03	2.20
39	GREENTOWN MANAGEMENT HOLDING	9979 HK	1,154,862.92	2.20
40	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	3320 HK	1,125,894.62	2.14
41	SINOPHARM GROUP CO-H	1099 HK	1,113,584.34	2.12
42	AKESO INC	9926 HK	1,088,331.55	2.07

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。

7.5.3 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	92,394,794.48
卖出收入（成交）总额	87,061,478.53

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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	CSOP HANG SENG TECH INDE-HKD	ETF	交易型 开放式	CSOP ASSET MANAGEMENT LIMITED	3,729,277.81	7.48

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	85,570.11
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,895.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,465.39

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份 额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
融通核心价值混合 (QDII) A	14,356	4,539.06	-	-	65,162,724.36	100.00
融通核心价值混合 (QDII) C	767	2,517.13	-	-	1,930,634.93	100.00
合计	15,123	4,436.51	-	-	67,093,359.29	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所 有从业人员持 有本基金	融通核心价值混合（QDII）A	5,898.55	0.00905
	融通核心价值混合（QDII）C	482.72	0.02500
	合计	6,381.27	0.00951

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 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	67,809,784.37	1,836,889.18
本报告期基金总申购份额	7,228,238.69	2,356,576.38
减：本报告期基金总赎回份额	9,875,298.70	2,262,830.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	65,162,724.36	1,930,634.93

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

1、2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本公司首席信息官由 Allen Yan（颜锡廉）变更为高翔，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2023 年 3 月 14 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任杜国彦为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

3、2023 年 4 月，经本公司股东会表决通过，由江涛先生担任公司董事，吕秋梅女士不再担任公司董事。

4、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任商小虎为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

5、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任王智鲲为公司财务负责人，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

10.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	-	91,396,909.56	50.93	28,596.91	50.30	-
大和资本	-	30,717,120.38	17.12	9,214.96	16.21	-
HTSC	-	30,125,560.60	16.79	9,037.68	15.90	-
Macquarie	-	12,335,914.17	6.87	3,700.78	6.51	-
CMS	-	9,666,202.09	5.39	2,899.88	5.10	-
CICC	-	5,214,566.21	2.91	3,408.07	5.99	-
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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
CLSA	-	-	-	-	-	-	3,926,094.32	100.00
大和资本	-	-	-	-	-	-	-	-
HTSC	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
CMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通基金关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-1-7
2	融通管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用“融通基金”名义进行诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-1-19
3	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-1-20
4	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开通转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-2-6
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增济安财富（北京）基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-2-20

6	关于旗下部分开放式基金新增海通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-2-20
7	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-2-27
8	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增博时财富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-3-6
9	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-3-14
10	融通基金管理有限公司关于公司董事变更情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-4-14
11	关于旗下部分开放式基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-4-18
12	关于旗下部分开放式基金新增诚通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-4-19
13	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-4-28
14	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-4-28
15	关于旗下部分开放式基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-5-18

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）设立的文件
- （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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2023 年 8 月 25 日