

融通价值成长混合型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通价值成长混合型证券投资基金(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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通价值成长混合型证券投资基金	
基金简称	融通价值成长混合基金	
基金主代码	015553	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 18 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	226,977,845.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C
下属分级基金的交易代码	015553	015554
报告期末下属分级基金的份额总额	178,866,326.97 份	48,111,518.69 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，精选优质证券进行中长期投资，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等部分。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中证香港 100 指数收益率×20%+中债综合全价（总值）指数收益率×20%
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，低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	秦一楠
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95599
传真		(0755) 26935005	(010) 68121816
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518053	100031
法定代表人		张威	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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

## 2.5 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)	
	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C
本期已实现收益	381,413.82	4,787,921.28
本期利润	5,659,623.13	-888,551.30
加权平均基金份额本期利润	0.0201	-0.0078
本期加权平均净值利润率	1.82%	-0.70%
本期基金份额净值增长率	1.64%	1.38%
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	11,739,040.55	2,921,493.43
期末可供分配基金份额利润	0.0656	0.0607
期末基金资产净值	191,172,895.63	51,177,400.91
期末基金份额净值	1.0688	1.0637
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	6.88%	6.37%

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

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

3、期末可供分配基金份额利润=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

融通价值成长混合 A

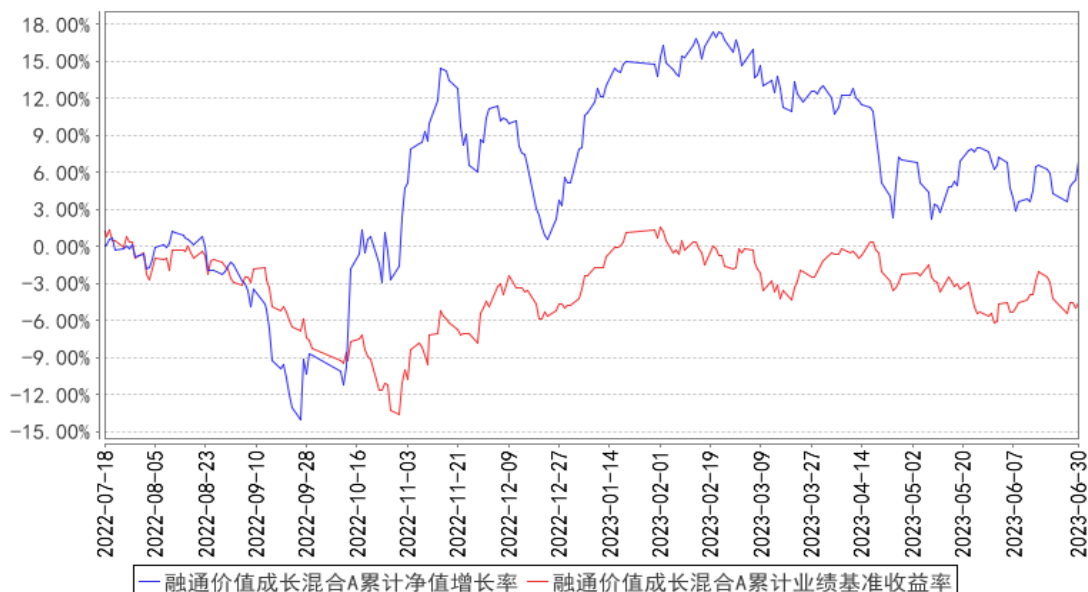
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.63%	0.96%	1.70%	0.73%	-1.07%	0.23%
过去三个月	-5.41%	1.06%	-3.42%	0.66%	-1.99%	0.40%
过去六个月	1.64%	0.99%	0.21%	0.68%	1.43%	0.31%
自基金合同生效起至今	6.88%	1.27%	-4.57%	0.82%	11.45%	0.45%

融通价值成长混合 C

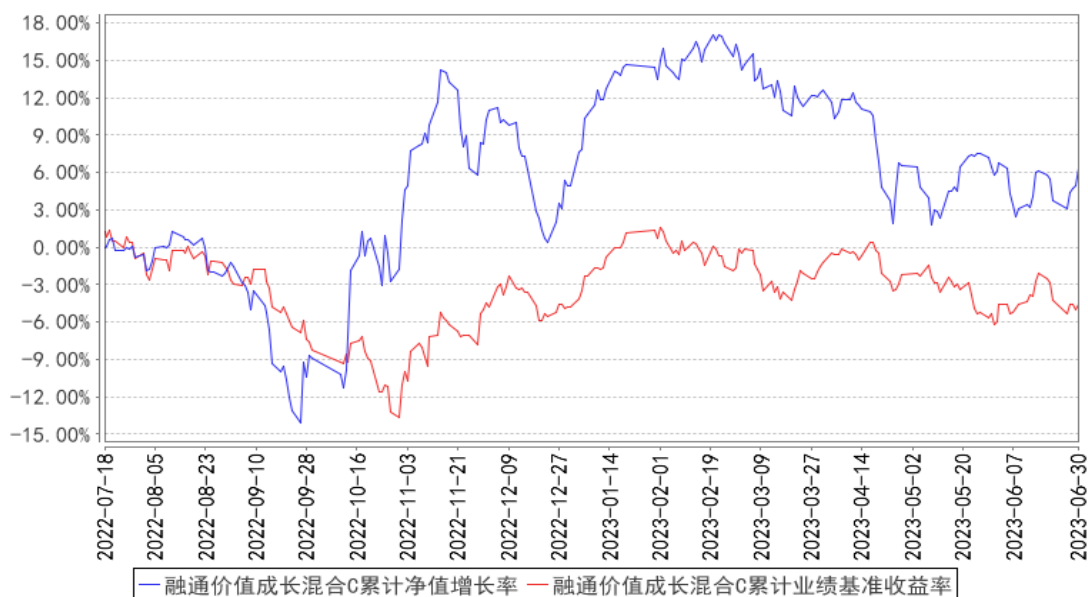
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.59%	0.96%	1.70%	0.73%	-1.11%	0.23%
过去三个月	-5.53%	1.06%	-3.42%	0.66%	-2.11%	0.40%
过去六个月	1.38%	0.99%	0.21%	0.68%	1.17%	0.31%
自基金合同生效起至今	6.37%	1.27%	-4.57%	0.82%	10.94%	0.45%

### 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

融通价值成长混合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



融通价值成长混合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：1、本基金基金合同生效日为 2022 年 7 月 18 日，至报告期末合同生效未满 1 年。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，至建仓期结束，各项资产配置比例符合合同约定。

### 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		
万民远	本基金的基金经理	2022年7月18日	-	12	万民远先生，博士，12年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2011年1月至2012年4月就职于中国银河证券任研究员，2012年5月至2014年4月就职于国海证券任研究员，2014年4月至2015年6月就职于融通基金管理有限公司任行业研究员，2015年6月至2016年6月就职于深圳前海明远睿达投资管理有限公司投资经理。2016年7月再次加入融通基金管理有限公司，曾任融通医疗保健行业混合型证券投资基金基金经理，现任融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通鑫新成长混合型证券投资基金基金经理、融通价值成长混合型证券投资基金基金经理、融通医疗保健行业混合型证券投资基金。

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。

##### 4.3.2 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。

#### 4.4 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

去年底国内疫情管控放开后，经济复苏预期渐明，A 股相关板块一季度迎来底部反弹。进入二季度，市场进入经济复苏检验期，除国内出行复苏超 2019 年外，不少行业及公司疫后复苏低于预期，三年大疫居民及地方政府的资产负债表均受影响，经济复苏的节奏有所放缓，但经济整体朝着疫后修复向好的方向不变。A 股市场整体表现为震荡，市场整体存量博弈特征较为明显，过去机构持仓较重的景气赛道依然处在持续调整中，但人工智能及中特估相关领域个股活跃。展望下半年，随着经济探底回升，我们对 A 股市场整体谨慎乐观。本基金投资风格上坚持“守正出奇，逆向投资”，用绝对收益的理念做相对收益。即注重个股的估值安全边际，通过集中个股、分散细分领域，同时放弃估值泡沫的收益来控制组合的回撤风险。同时重点把握拐点型公司戴维斯双击机会，挖掘隐形龙头价值发现的机会。个股选择则坚持“逆向思维，人多的地方不去”原则，在企业经营阶段性低点布局，组合构建遵循产业趋势优先，成长与估值匹配，不追逐短期热点，提前预判，做孤独的“拐点型”价值发现者。

本基金按照基金契约规定要求，精选赛道及成长性较好且估值相对较低的板块及个股进行重点配置，中线持股的心态从容守候，用时间换空间，并适时调整组合结构。预计 A 股市场过去 2 年的景气赛道拔估值行情难以持续，A 股市场风格有望从过去的极致走向平衡，稳增长、疫后修复以及估值匹配的优质成长股均有望迎来价值投资机会。目前基金重点布局低位的医药、消费、新能源及科技等板块。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通价值成长混合 A 基金份额净值为 1.0688 元，本报告期基金份额净值增长

率为 1.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%；

截至本报告期末融通价值成长混合 C 基金份额净值为 1.0637 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.38%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管新冠疫情的反复对全球经济的冲击依然存在，但不改全球经济自身运行趋势秩序的恢复。年初疫情管控放开后，市场整体预期国内经济复苏，一季度整体经济确实表现出补偿性复苏，但受困于三年疫情，居民及地方政府的资产负债表均有所损伤，修复需要一些时间，受出口下滑等影响，二季度国内经济有所回落。尽管国内经济短期虽有压力但依然可控，且展望下半年，促销费等稳增长政策有望持续发力，加之灵活的财政政策及货币政策发力，经济弱复苏的态势有望延续。中国经济正处在结构升级转型期，将从过去的高速增长进入高质量增长，我们对中国经济长期发展充满信心。

上半年，除 AI 及部分中特估整体表现较好外，过去 2 年表现较好的医药、新能源及消费等景气赛道个股持续调整，A 股市场整体弱势震荡，短期市场整体表现为存量博弈，跷跷板效应较为明显。目前风险释放已经反应了较为悲观的预期，展望后市，我们对 A 股市场不悲观，目前处在底部附近，指数的贝塔机会不大，预计震荡向上，但结构性机会将长期存在，居民资产向权益转移的趋势也依然不变。

A 股景气赛道资产经历了过去大起大落走势后，预计 A 股市场风格有望从过去的极致走向平衡，稳增长、疫后修复以及估值匹配的优质成长股均有望迎来价值投资机会，我们依然坚持顺着中国经济转型升级和疫后修复的方向寻找投资机会。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—融通基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：融通价值成长混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,957,519.91	67,706,036.78
结算备付金		698,667.26	1,526,560.17
存出保证金		158,284.61	406,742.87
交易性金融资产	6.4.7.2	227,369,675.59	464,155,665.87
其中：股票投资		227,369,675.59	464,155,665.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		1,297,533.02	-
应收股利		-	-
应收申购款		219,490.22	534,439.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		243,701,170.61	534,329,445.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.78	41,282,774.12
应付赎回款		271,909.43	684,691.26
应付管理人报酬		349,958.47	587,817.26
应付托管费		58,326.39	97,969.55
应付销售服务费		20,148.66	42,436.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	4.33

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	650,529.34	1,191,396.35
负债合计		1,350,874.07	43,887,089.32
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	226,977,845.66	466,690,857.83
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	15,372,450.88	23,751,498.00
净资产合计		242,350,296.54	490,442,355.83
负债和净资产总计		243,701,170.61	534,329,445.15

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 226,977,845.66 份，其中融通价值成长混合 A 基金份额总额 178,866,326.97 份，基金份额净值 1.0688 元；融通价值成长混合 C 基金份额总额 48,111,518.69 份，基金份额净值 1.0637 元。

## 6.2 利润表

会计主体：融通价值成长混合型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		8,985,152.06
1. 利息收入		113,311.12
其中：存款利息收入	6.4.7.13	113,311.12
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（损失以“-”填列）		8,686,478.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,047,704.56
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	1,638,773.80
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（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-398,263.27

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	583, 625. 85
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4, 214, 080. 23</b>
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 260, 580. 93
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	543, 430. 12
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	314, 798. 66
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. 22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	95, 270. 52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4, 771, 071. 83</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4, 771, 071. 83</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>4, 771, 071. 83</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通价值成长混合型证券投资基金

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）	466, 690, 857. 83	-	23, 751, 498. 00	490, 442, 355. 83
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）	466, 690, 857. 83	-	23, 751, 498. 00	490, 442, 355. 83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-239, 713, 012. 17	-	-8, 379, 047. 12	-248, 092, 059. 29
（一）、综合收益总额	-	-	4, 771, 071. 83	4, 771, 071. 83
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-239, 713, 012. 17	-	-13, 150, 118. 95	-252, 863, 131. 12

其中：1. 基金申购款	170,329,067.29	-	20,712,120.70	191,041,187.99
2. 基金赎回款	-410,042,079.46	-	-33,862,239.65	-443,904,319.11
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(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）	226,977,845.66	-	15,372,450.88	242,350,296.54

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 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

融通价值成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]626号《关于准予融通价值成长混合型证券投资基金注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 935,144,034.43 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0543 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 7 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 935,362,715.48 份基金份额,其中认购资金利息折合 218,681.05 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》和《融通价值成长混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用但不计提销售服务费的基金份额类别,称为 A 类基金份额;不收取认购费和申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股



票(包括主板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 60%-95%(其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金(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%。本基金业绩比较基准为:中证 800 指数收益率 $\times$ 60%+中证香港 100 指数收益率 $\times$ 20%+中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 20%。

#### 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》、《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》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[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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，对国债、地方政府债以及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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 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	13,957,519.91
等于：本金	13,954,644.92
加：应计利息	2,874.99
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	13,957,519.91

##### 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	250,902,788.25	-	227,369,675.59	-23,533,112.66
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	250,902,788.25	-	227,369,675.59	-23,533,112.66

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

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	634.32
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	565,592.46
其中：交易所市场	565,592.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
合计	650,529.34

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 融通价值成长混合 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	336,452,187.73	336,452,187.73
本期申购	97,758,322.80	97,758,322.80
本期赎回（以“-”号填列）	-255,344,183.56	-255,344,183.56
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	178,866,326.97	178,866,326.97

## 融通价值成长混合 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	130,238,670.10	130,238,670.10
本期申购	72,570,744.49	72,570,744.49
本期赎回（以“-”号填列）	-154,697,895.90	-154,697,895.90
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	48,111,518.69	48,111,518.69

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

## 融通价值成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,848,199.08	-16,499,088.04	17,349,111.04
本期利润	381,413.82	5,278,209.31	5,659,623.13
本期基金份额交易产生的变动数	-22,490,572.35	11,788,406.84	-10,702,165.51
其中：基金申购款	12,849,818.29	-1,221,184.67	11,628,633.62
基金赎回款	-35,340,390.64	13,009,591.51	-22,330,799.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,739,040.55	567,528.11	12,306,568.66

## 融通价值成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,784,685.51	-6,382,298.55	6,402,386.96
本期利润	4,787,921.28	-5,676,472.58	-888,551.30
本期基金份额交易产生的变动数	-14,651,113.36	12,203,159.92	-2,447,953.44
其中：基金申购款	9,177,775.39	-94,288.31	9,083,487.08
基金赎回款	-23,828,888.75	12,297,448.23	-11,531,440.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,921,493.43	144,388.79	3,065,882.22

## 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	104,917.65
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	5,829.11
其他	2,564.36
合计	113,311.12

## 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	7,047,704.56
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	7,047,704.56
----	--------------

## 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	684,564,839.76
减：卖出股票成本总额	675,707,162.13
减：交易费用	1,809,973.07
买卖股票差价收入	7,047,704.56

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 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	1,638,773.80
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	1,638,773.80

## 6.4.7.20 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	-398,263.27
股票投资	-398,263.27
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	-398,263.27

## 6.4.7.21 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	547,417.86
基金转换费收入	36,207.99
合计	583,625.85

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金赎回费用的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

#### 6.4.7.23 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	10,967.96
合计	95,270.52

#### 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

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 权证交易

无。

## 6.4.10.1.5 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
当期发生的基金应支付的管理费	3,260,580.93
其中：支付销售机构的客户维护费	897,199.78

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：日管理人报酬 = 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
当期发生的基金应支付的托管费	543,430.12

注：支付基金托管人中国农业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		
	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C	合计
融通基金	-	173,596.28	173,596.28
中国农业银行	-	13,493.14	13,493.14
诚通证券	-	9,400.87	9,400.87
合计	-	196,490.29	196,490.29

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：

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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	13,957,519.91	104,917.65

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	1-6 个月（含）	首发流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023-03-31	1-6 个月（含）	首发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	1-6 个月（含）	首发流通受限	11.88	21.02	527	6,260.76	11,077.54	-
001324	长青科技	2023-05-12	1-6 个月（含）	首发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	1-6 个月（含）	首发流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	1-6 个月（含）	首发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	1-6 个月（含）	首发流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	1-6 个月（含）	首发流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023-06-15	1-6 个月（含）	首发流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	1-6 个月（含）	首发流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023-03-01	1-6 个月（含）	首发流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	1-6 个月（含）	首发流通受限	34.00	34.93	244	8,296.00	8,522.92	-
301202	朗威	2023-06-28	1 个月内	首发流	25.82	25.82	1,916	49,471.12	49,471.12	-

	股份		(含)	通受限							
301202	朗威股份	2023-06-28	1-6个月(含)	首发流通受限	25.82	25.82	213	5,499.66	5,499.66	-	
301203	国泰环保	2023-03-28	1-6个月(含)	首发流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-	
301210	金杨股份	2023-06-21	1-6个月(含)	首发流通受限	57.88	49.17	150	8,682.00	7,375.50	-	
301225	恒勃股份	2023-06-08	1-6个月(含)	首发流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-	
301232	飞沃科技	2023-06-08	1-6个月(含)	首发流通受限	72.50	58.42	161	11,672.50	9,405.62	-	
301260	格力博	2023-01-20	1-6个月(含)	首发流通受限	30.85	23.63	1,003	30,942.55	23,700.89	-	
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内(含)	首发流通受限	36.90	36.90	1,319	48,671.10	48,671.10	-	
301261	恒工精密	2023-06-29	1-6个月(含)	首发流通受限	36.90	36.90	147	5,424.30	5,424.30	-	
301262	海看股份	2023-06-13	1-6个月(含)	首发流通受限	30.22	25.50	462	13,961.64	11,781.00	-	
301281	科源制药	2023-03-28	1-6个月(含)	首发流通受限	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-	
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月(含)	送股流通受限	-	25.10	96	-	2,409.60	-	
301291	明阳电气	2023-06-21	1-6个月(含)	首发流通受限	38.13	31.03	316	12,049.08	9,805.48	-	
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内(含)	首发流通受限	19.99	19.99	3,703	74,022.97	74,022.97	-	
301292	海科新源	2023-06-29	1-6个月(含)	首发流通受限	19.99	19.99	412	8,235.88	8,235.88	-	
301293	三博脑科	2023-04-25	1-6个月(含)	首发流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-	
301295	美硕科技	2023-06-19	1-6个月(含)	首发流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-	
301301	川宁生物	2022-12-20	1-6个月(含)	首发流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-	
301303	真兰仪表	2023-02-13	1-6个月(含)	首发流通受限	26.80	22.32	867	23,235.60	19,351.44	-	
301305	朗坤环境	2023-05-15	1-6个月(含)	首发流通受限	25.25	19.69	611	15,427.75	12,030.59	-	
301307	美利信	2023-04-14	1-6个月(含)	首发流通受限	32.34	31.86	614	19,856.76	19,562.04	-	
301315	威士顿	2023-06-13	1-6个月(含)	首发流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-	

301317	鑫磊股份	2023-01-12	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023-06-01	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023-02-27	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	131.11	53.24	153	20,059.83	8,145.72	-
301322	绿通科技	2023-05-25	1-6 个月 (含)	送股流 通受限	-	53.24	76	-	4,046.24	-
301323	新莱福	2023-05-29	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	39.06	39.36	200	7,812.00	7,872.00	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	76.80	107.95	232	17,817.60	25,044.40	-
301332	德尔玛	2023-05-09	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	14.81	13.73	910	13,477.10	12,494.30	-
301337	亚华电子	2023-05-16	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	73.45	46.64	123	9,034.35	5,736.72	-
301355	南王科技	2023-06-02	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	23.77	42.89	607	14,428.39	26,034.23	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	24.66	22.51	409	10,085.94	9,206.59	-
301382	蜂助手	2023-05-09	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023-03-21	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023-04-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内 (含)	首发流 通受限	26.68	26.68	3,312	88,364.16	88,364.16	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.68	26.68	368	9,818.24	9,818.24	-
301397	溯联股份	2023-06-15	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	53.27	40.20	258	13,743.66	10,371.60	-
301399	英特科技	2023-05-16	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人	2023-02-22	1-6 个月	首发流	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-

	健康		(含)	通受限							
301419	阿莱德	2023-02-02	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023-05-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301439	泓淋电力	2023-03-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	19.99	16.90	639	12,773.61	10,799.10	-	
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内 (含)	首发流 通受限	57.66	57.66	1,538	88,681.08	88,681.08	-	
301486	致尚科技	2023-06-30	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	57.66	57.66	171	9,859.86	9,859.86	-	
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内 (含)	首发流 通受限	39.78	39.78	1,952	77,650.56	77,650.56	-	
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	39.78	39.78	217	8,632.26	8,632.26	-	
601061	中信金属	2023-03-30	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	6.58	7.58	1,421	9,350.18	10,771.18	-	
601065	江盐集团	2023-03-31	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	10.36	11.84	534	5,532.24	6,322.56	-	
601133	柏诚股份	2023-03-31	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	11.66	12.26	494	5,760.04	6,056.44	-	
603125	常青科技	2023-03-30	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-	
603135	中重科技	2023-03-29	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	17.80	17.89	492	8,757.60	8,801.88	-	
603137	恒尚节能	2023-04-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
603172	万丰股份	2023-04-28	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	
688146	中船特气	2023-04-13	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	36.15	38.13	462	16,701.30	17,616.06	-	
688249	晶合集成	2023-04-24	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	19.86	18.06	2,629	52,211.94	47,479.74	-	
688334	西高院	2023-06-09	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	14.16	16.21	720	10,195.20	11,671.20	-	
688352	颀中科技	2023-04-11	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	12.10	12.07	1,334	16,141.40	16,101.38	-	
688361	中科飞测	2023-05-12	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	23.60	64.67	432	10,195.20	27,937.44	-	
688429	时创能源	2023-06-20	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	19.20	25.53	265	5,088.00	6,765.45	-	
688433	华曙高科	2023-04-07	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-	

688443	智翔金泰	2023-06-13	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	37.88	29.49	477	18,068.76	14,066.73	-
688458	美芯晟	2023-05-15	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	75.00	90.76	168	12,600.00	15,247.68	-
688469	中芯集成	2023-04-28	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	5.69	5.41	4,527	25,758.63	24,491.07	-
688472	阿特斯	2023-06-02	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	11.10	17.04	1,426	15,828.60	24,299.04	-
688478	晶升股份	2023-04-13	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	33.99	29.49	296	10,061.04	8,729.04	-
688484	南芯科技	2023-03-28	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	39.99	36.71	467	18,675.33	17,143.57	-
688507	索辰科技	2023-04-10	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	245.56	122.11	78	19,153.68	9,524.58	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6 个月 (含)	送股流 通受限	-	122.11	37	-	4,518.07	-
688512	慧智微	2023-05-08	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	20.92	19.16	617	12,907.64	11,821.72	-
688523	航天环宇	2023-05-26	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023-03-24	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	152.38	135.97	168	25,599.84	22,842.96	-
688535	华海诚科	2023-03-28	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023-06-14	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	43.67	53.05	239	10,437.13	12,678.95	-
688552	航天南湖	2023-05-08	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	21.17	23.50	584	12,363.28	13,724.00	-
688562	航天软件	2023-05-15	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688576	西山科技	2023-05-30	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	135.80	120.41	137	18,604.60	16,496.17	-
688581	安杰思	2023-05-12	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	125.80	118.03	107	13,460.60	12,629.21	-
688582	芯动联科	2023-06-21	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	26.74	40.68	273	7,300.02	11,105.64	-
688593	新相微	2023-05-25	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	11.18	14.59	799	8,932.82	11,657.41	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内 (含)	首发流 通受限	55.00	55.00	1,063	58,465.00	58,465.00	-
688603	天承	2023-06-30	1-6 个月	首发流	55.00	55.00	119	6,545.00	6,545.00	-



	科技		(含)	通受限						
688620	安凯微	2023-06-15	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	125.88	86.79	91	11,455.08	7,897.89	-
688629	华丰科技	2023-06-16	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	1-6 个月 (含)	首发流 通受限	25.28	29.87	256	6,471.68	7,646.72	-

注：1. 根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2. 基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金如果投资港股通标的股票，可能会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。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。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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托管人中国农业银行，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	13,957,519.91	-	-	-	13,957,519.91
结算备付金	698,667.26	-	-	-	698,667.26
存出保证金	158,284.61	-	-	-	158,284.61
交易性金融资产	-	-	-	-227,369,675.59	227,369,675.59
应收申购款	-	-	-	219,490.22	219,490.22
应收清算款	-	-	-	1,297,533.02	1,297,533.02
资产总计	14,814,471.78	-	-	-228,886,698.83	243,701,170.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	271,909.43	271,909.43
应付管理人报酬	-	-	-	349,958.47	349,958.47
应付托管费	-	-	-	58,326.39	58,326.39
应付清算款	-	-	-	1.78	1.78
应付销售服务费	-	-	-	20,148.66	20,148.66
其他负债	-	-	-	650,529.34	650,529.34
负债总计	-	-	-	1,350,874.07	1,350,874.07
利率敏感度缺口	14,814,471.78	-	-	-227,535,824.76	242,350,296.54
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	67,706,036.78	-	-	-	67,706,036.78
结算备付金	1,526,560.17	-	-	-	1,526,560.17
存出保证金	406,742.87	-	-	-	406,742.87
交易性金融资产	-	-	-	-464,155,665.87	464,155,665.87
应收申购款	-	-	-	534,439.46	534,439.46
资产总计	69,639,339.82	-	-	-464,690,105.33	534,329,445.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	684,691.26	684,691.26
应付管理人报酬	-	-	-	587,817.26	587,817.26
应付托管费	-	-	-	97,969.55	97,969.55
应付清算款	-	-	-	41,282,774.12	41,282,774.12
应付销售服务费	-	-	-	42,436.45	42,436.45
应交税费	-	-	-	4.33	4.33
其他负债	-	-	-	1,191,396.35	1,191,396.35
负债总计	-	-	-	43,887,089.32	43,887,089.32
利率敏感度缺口	69,639,339.82	-	-	-420,803,016.01	490,442,355.83

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 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				
交易性金融资产	-	8,348,238.48	-	8,348,238.48
资产合计	-	8,348,238.48	-	8,348,238.48
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	8,348,238.48	-	8,348,238.48

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				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外币以外的其他市场变量保持不变		
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）		上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	本期末 (2023 年 6 月 30 日)		
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	417,411.92	-
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-417,411.92	-

#### 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，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资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 60% - 95%(其中投资于港股通标的股票的比例占本基金股票资产的 0%-50%)；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风

险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	227,369,675.59	93.82	464,155,665.87	94.64
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	227,369,675.59	93.82	464,155,665.87	94.64

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数以外的其他市场变量保持不变		
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）	
分析	中证 800 指数收益率上升 5%	8,303,160.36	21,790,158.10
	中证 800 指数收益率下降 5%	-8,303,160.36	-21,790,158.10

#### 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	225,731,300.65	462,556,638.53
第二层次	539,341.19	242,529.30
第三层次	1,099,033.75	1,356,498.04
合计	227,369,675.59	464,155,665.87

#### 6.4.14.2 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、债券和基金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	227,369,675.59	93.30
	其中：股票	227,369,675.59	93.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	14,656,187.17	6.01
8	其他各项资产	1,675,307.85	0.69
9	合计	243,701,170.61	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	183,661,132.99	75.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	8,431.95	0.00
F	批发和零售业	31,938,874.36	13.18
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	97,401.55	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,236,595.34	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	19,770.59	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	219,021,437.11	90.37

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	5,942,124.22	2.45
医疗保健	2,406,114.26	0.99
金融	-	-
科技	-	-
通讯	-	-

公用事业	-	-
政府	-	-
合计	8,348,238.48	3.44

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002727	一心堂	661,900	17,474,160.00	7.21
2	605266	健之佳	172,000	14,418,760.00	5.95
3	300122	智飞生物	300,000	13,260,000.00	5.47
4	603822	嘉澳环保	350,000	11,392,500.00	4.70
5	000661	长春高新	80,500	10,972,150.00	4.53
6	300118	东方日升	420,000	10,764,600.00	4.44
7	600522	中天科技	480,000	7,636,800.00	3.15
8	300274	阳光电源	62,000	7,231,060.00	2.98
9	300068	南都电源	365,000	7,066,400.00	2.92
10	603237	五芳斋	232,740	7,059,004.20	2.91
11	300981	中红医疗	455,890	6,906,733.50	2.85
12	603520	司太立	410,000	6,838,800.00	2.82
13	603059	倍加洁	280,000	6,367,200.00	2.63
14	02367	巨子生物	185,200	5,942,124.22	2.45
15	688123	聚辰股份	104,000	5,586,880.00	2.31
16	600566	济川药业	189,908	5,514,928.32	2.28
17	002773	康弘药业	250,000	4,780,000.00	1.97
18	688607	康众医疗	250,000	4,780,000.00	1.97
19	300705	九典制药	180,000	4,757,400.00	1.96
20	002873	新天药业	350,000	4,732,000.00	1.95
21	300593	新雷能	200,000	4,582,000.00	1.89
22	300677	英科医疗	200,000	4,400,000.00	1.82
23	300763	锦浪科技	40,000	4,164,000.00	1.72
24	688234	天岳先进	50,000	3,697,000.00	1.53
25	300652	雷迪克	150,000	3,415,500.00	1.41
26	300125	聆达股份	200,000	3,376,000.00	1.39
27	688518	联赢激光	120,000	3,343,200.00	1.38
28	300633	开立医疗	60,000	3,270,000.00	1.35
29	688621	阳光诺和	54,827	3,224,924.14	1.33
30	603165	荣晟环保	200,000	3,208,000.00	1.32
31	002812	恩捷股份	30,000	2,890,500.00	1.19
32	300750	宁德时代	11,840	2,708,873.60	1.12
33	688366	昊海生科	30,091	2,534,264.02	1.05
34	02269	药明生物	69,500	2,406,114.26	0.99
35	300358	楚天科技	150,000	2,239,500.00	0.92

36	688687	凯因科技	70,000	2,065,000.00	0.85
37	688117	圣诺生物	70,000	2,023,000.00	0.83
38	301097	天益医疗	40,000	1,913,200.00	0.79
39	688136	科兴制药	100,000	1,865,000.00	0.77
40	603811	诚意药业	149,980	1,864,251.40	0.77
41	688367	工大高科	100,000	1,768,000.00	0.73
42	688115	思林杰	30,000	1,158,900.00	0.48
43	688443	智翔金泰	4,766	146,639.72	0.06
44	301486	致尚科技	1,709	98,540.94	0.04
45	301395	仁信新材	3,680	98,182.40	0.04
46	301488	豪恩汽电	2,169	86,282.82	0.04
47	301292	海科新源	4,115	82,258.85	0.03
48	688603	天承科技	1,182	65,010.00	0.03
49	301202	朗威股份	2,129	54,970.78	0.02
50	301261	恒工精密	1,466	54,095.40	0.02
51	688249	晶合集成	2,629	47,479.74	0.02
52	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
53	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
54	688361	中科飞测	432	27,937.44	0.01
55	301358	湖南裕能	607	26,034.23	0.01
56	301325	曼恩斯特	232	25,044.40	0.01
57	688469	中芯集成	4,527	24,491.07	0.01
58	688472	阿特斯	1,426	24,299.04	0.01
59	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.01
60	301260	格力博	1,003	23,700.89	0.01
61	688531	日联科技	168	22,842.96	0.01
62	301307	美利信	614	19,562.04	0.01
63	301303	真兰仪表	867	19,351.44	0.01
64	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
65	688146	中船特气	462	17,616.06	0.01
66	688484	南芯科技	467	17,143.57	0.01
67	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.01
68	688576	西山科技	137	16,496.17	0.01
69	688562	航天软件	726	16,197.06	0.01
70	688352	颀中科技	1,334	16,101.38	0.01
71	688458	美芯晟	168	15,247.68	0.01
72	301399	英特科技	293	15,110.01	0.01
73	301408	华人健康	879	14,899.05	0.01
74	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
75	688507	索辰科技	115	14,042.65	0.01
76	301387	光大同创	307	13,925.52	0.01
77	688552	航天南湖	584	13,724.00	0.01
78	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.01

79	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.01
80	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.01
81	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.01
82	688543	国科军工	239	12,678.95	0.01
83	688581	安杰思	107	12,629.21	0.01
84	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.01
85	301332	德尔玛	910	12,494.30	0.01
86	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.01
87	301322	绿通科技	229	12,191.96	0.01
88	301305	朗坤环境	611	12,030.59	0.00
89	688512	慧智微	617	11,821.72	0.00
90	301262	海看股份	462	11,781.00	0.00
91	688334	西高院	720	11,671.20	0.00
92	688593	新相微	799	11,657.41	0.00
93	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
94	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
95	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
96	688582	芯动联科	273	11,105.64	0.00
97	001287	中电港	527	11,077.54	0.00
98	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
99	301439	泓淋电力	639	10,799.10	0.00
100	601061	中信金属	1,421	10,771.18	0.00
101	301397	溯联股份	258	10,371.60	0.00
102	301291	明阳电气	316	9,805.48	0.00
103	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
104	301232	飞沃科技	161	9,405.62	0.00
105	301376	致欧科技	409	9,206.59	0.00
106	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
107	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
108	603135	中重科技	492	8,801.88	0.00
109	688479	友车科技	296	8,729.04	0.00
110	301170	锡南科技	244	8,522.92	0.00
111	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
112	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
113	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
114	688623	双元科技	91	7,897.89	0.00
115	301323	新莱福	200	7,872.00	0.00
116	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
117	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
118	688631	莱斯信息	256	7,646.72	0.00
119	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
120	301210	金杨股份	150	7,375.50	0.00
121	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00

122	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
123	688429	时创能源	265	6,765.45	0.00
124	601065	江盐集团	534	6,322.56	0.00
125	601133	柏诚股份	494	6,056.44	0.00
126	301345	涛涛车业	123	5,736.72	0.00
127	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
128	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
129	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
130	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
131	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
132	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
133	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
134	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
135	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300118	东方日升	25,415,384.18	5.18
2	688123	聚辰股份	24,566,650.66	5.01
3	002223	鱼跃医疗	23,168,312.01	4.72
4	605266	健之佳	22,302,560.55	4.55
5	600256	广汇能源	17,969,047.00	3.66
6	300633	开立医疗	16,413,922.05	3.35
7	300125	聆达股份	16,221,145.94	3.31
8	000977	浪潮信息	15,132,920.00	3.09
9	002727	一心堂	13,768,054.00	2.81
10	603811	诚意药业	13,727,952.21	2.80
11	603883	老百姓	12,480,567.08	2.54
12	002919	名臣健康	11,664,574.20	2.38
13	000661	长春高新	11,289,385.00	2.30
14	688607	康众医疗	10,879,170.26	2.22
15	688117	圣诺生物	9,842,580.09	2.01
16	300274	阳光电源	9,665,633.01	1.97
17	300677	英科医疗	8,772,734.80	1.79
18	603059	倍加洁	8,696,727.00	1.77
19	300981	中红医疗	7,939,628.94	1.62
20	603233	大参林	7,911,935.81	1.61

注：“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。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002727	一心堂	31,101,617.00	6.34
2	605266	健之佳	30,109,531.36	6.14
3	000661	长春高新	25,574,279.13	5.21
4	002223	鱼跃医疗	24,462,513.00	4.99
5	301103	何氏眼科	23,322,139.83	4.76
6	002812	恩捷股份	21,803,824.88	4.45
7	688123	聚辰股份	21,299,262.88	4.34
8	600522	中天科技	20,101,831.72	4.10
9	603883	老百姓	20,092,411.70	4.10
10	600256	广汇能源	19,444,435.00	3.96
11	300633	开立医疗	15,542,935.42	3.17
12	000977	浪潮信息	15,246,302.00	3.11
13	603811	诚意药业	14,804,613.60	3.02
14	688580	伟思医疗	14,512,131.52	2.96
15	002919	名臣健康	14,058,910.00	2.87
16	300118	东方日升	12,967,705.00	2.64
17	603020	爱普股份	12,732,576.00	2.60
18	688518	联赢激光	12,361,571.30	2.52
19	300759	康龙化成	11,710,254.00	2.39
20	603896	寿仙谷	11,341,137.00	2.31
21	688117	圣诺生物	11,132,506.67	2.27
22	688800	瑞可达	10,817,906.62	2.21
23	300122	智飞生物	10,685,097.38	2.18
24	688159	有方科技	10,001,134.46	2.04
25	688202	美迪西	9,868,110.34	2.01
26	603987	康德莱	9,815,000.40	2.00

注：“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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	439,319,435.12
卖出股票收入（成交）总额	684,564,839.76

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

无。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金的国债期货投资将以风险管理为原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具对投资组合进行管理。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

无。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 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。

**7.12.2 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。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	158,284.61
2	应收清算款	1,297,533.02



3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	219,490.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,675,307.85

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.6 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 (%)
融通价值 成长混合 A	4,619	38,724.04	8,036,616.16	4.49	170,829,710.81	95.51
融通价值 成长混合 C	1,645	29,247.12	15,718,820.29	32.67	32,392,698.40	67.33
合计	6,264	36,235.29	23,755,436.45	10.47	203,222,409.21	89.53

#### 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	融通价值成长混合 A	1,253,561.02	0.70084
	融通价值成长混合 C	869,232.86	1.80670
	合计	2,122,793.88	0.93524

#### 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	融通价值成长混合 A	>100
	融通价值成长混合 C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	融通价值成长混合 A	0
	融通价值成长混合 C	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C
基金合同生效日 (2022 年 7 月 18 日) 基金份额总额	832,102,008.32	103,260,707.16
本报告期期初基金份额总额	336,452,187.73	130,238,670.10
本报告期基金总申购份额	97,758,322.80	72,570,744.49
减：本报告期基金总赎回份额	255,344,183.56	154,697,895.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	178,866,326.97	48,111,518.69

### § 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，本基金的托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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(%)	
国联证券	1	317,847,009.41	28.60	292,832.41	28.67	-
广发证券	1	182,920,797.35	16.46	168,517.32	16.50	-
民生证券	1	181,632,579.36	16.34	164,568.15	16.11	-
海通证券	2	175,134,337.45	15.76	161,371.46	15.80	-
申万宏源	1	133,233,841.12	11.99	122,749.56	12.02	-
招商证券	1	120,741,944.34	10.86	111,239.38	10.89	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

国泰君安	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

### 3、交易单元变更情况

本报告期内，本基金无交易单元变更。

## 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	
	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 (%)
国联证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	20230107
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	20230119
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	20230120
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	20230206
5	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	20230227
6	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	20230306
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	20230314
8	融通价值成长混合型证券投资基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并开通定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	20230317
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	20230414
10	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	20230418
11	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	20230428
12	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	20230428
13	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加珠海盈米基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	20230522

14	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陆金所基金销售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	20230615
----	--	--------------	----------

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20230611	138,887,438.24	0.00	138,887,438.24	0.00	0.00
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通价值成长混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通价值成长混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通价值成长混合型证券投资基金招募说明书》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,或登陆本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2023 年 8 月 25 日