

摩根全球新兴市场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：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
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	38
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	38
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52
7.11 本报告期投资基金情况	52
7.12 投资组合报告附注	52
8 基金份额持有人信息	53

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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的情况	54
9 开放式基金份额变动.....	54
10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
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	55
10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	62
11 影响投资者决策的其他重要信息	62
12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)
基金简称	摩根全球新兴市场混合(QDII)
基金主代码	378006
交易代码	378006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 30 日
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	48,393,591.26 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于新兴市场以及在其他证券市场交易的新兴市场企业，通过深入挖掘新兴市场企业的投资价值，努力实现基金资产稳健增值。
投资策略	新兴市场所属国家和地区经济发展多处于转型阶段，劳动力成本低，自然资源丰富，与发达国家与地区比较，其经济发展速度一般相对较高。本基金将充分分享新兴市场经济高增长成果，审慎把握新兴市场的投资机会，争取为投资者带来长期稳健回报。 1、股票投资策略 总体上本基金将采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。首先通过考察不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度，决定地区与板块的基本布局；其次采取自下而上的选股策略，在对股票进行基本面分析的同时，通过深入研究股票的价值与动量特性，选取目标投资对象。在固定收益类投资部分，本基金将综合考虑资产布局的安全性、流动性与收益性，并结合现金管理要求等来制订具体策略。 2、固定收益类投资策略 本基金将根据风险防御及现金替代性管理的需要，适度进行债券投资。本基金在对新兴市场中不同国家和地区宏观经济发展情况、财政政策、货币政策、以及利率走势进行分析的基础上，综合考查利率风险、信用和流动性风险对债券内在价值的影响，构建固定收益类投资组合，以追求长期低波动率的稳健回报。 3、其他投资策略：包括衍生品投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：MSCI 新兴市场股票指数（总回报）
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。 根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销

	售机构提供的评级结果为准。
--	---------------

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		摩根基金管理（中国）有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邹树波	王小飞
	联系电话	021-38794888	021-60637103
	电子邮箱	services@cifm.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	021-60637228
传真		021-20628400	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼25楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		王琼慧	田国立

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	JPMORGAN ASSET MANAGEMENT (UK) LIMITED	JPMorgan & Chase Bank, N.A.
	中文	摩根资产管理(英国)有限公司	摩根大通银行
注册地址		25 Bank Street, Canary Wharf, London, E14 5JP, United Kingdom	1111 Polaris Parkway, Columbus, Ohio 43240, USA
办公地址		60 Victoria Embankment, London, EC4Y 0JP, United Kingdom	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001
邮政编码		-	-

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	am.jpmorgan.com/cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	摩根基金管理（中国）有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 楼

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 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-1,222,219.30
本期利润	4,322,257.83
加权平均基金份额本期利润	0.0907
本期加权平均净值利润率	9.39%
本期基金份额净值增长率	9.60%
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	-6,007,890.87
期末可供分配基金份额利润	-0.1241
期末基金资产净值	49,392,275.23
期末基金份额净值	1.0206
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	10.98%

注：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。

上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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

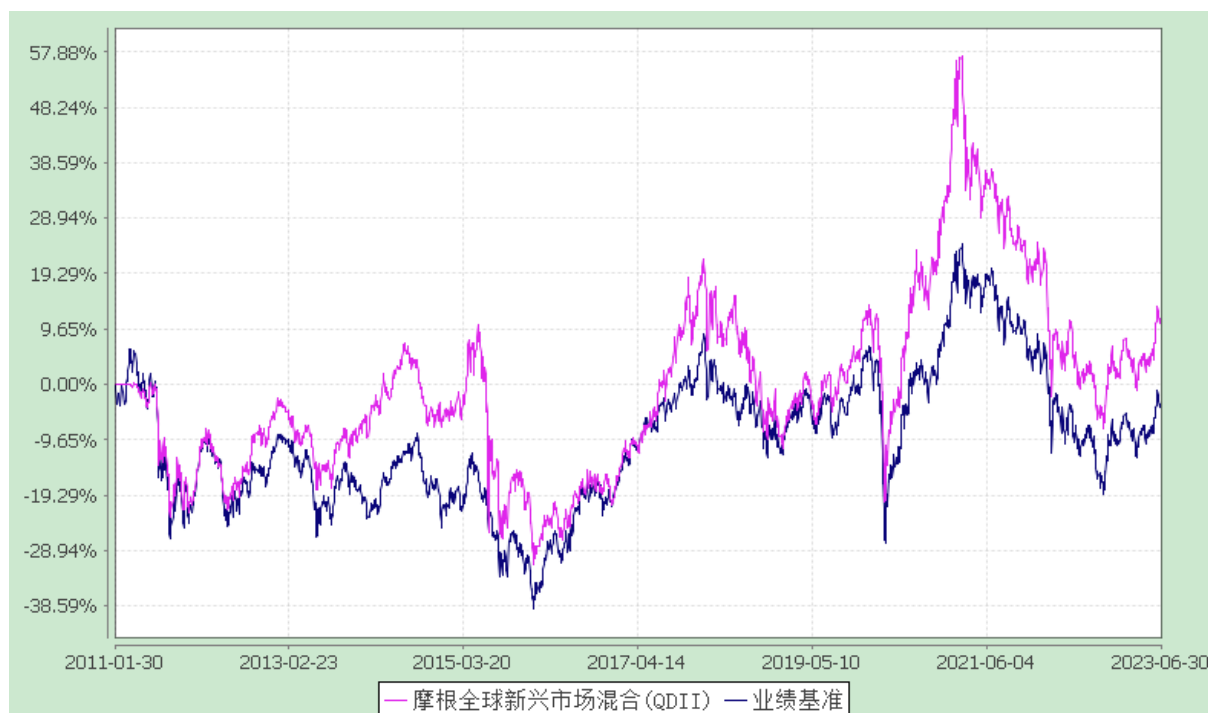
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.50%	0.74%	5.32%	0.78%	1.18%	-0.04%
过去三个月	6.36%	0.72%	5.07%	0.68%	1.29%	0.04%
过去六个月	9.60%	0.85%	7.34%	0.82%	2.26%	0.03%
过去一年	8.14%	0.96%	6.46%	0.97%	1.68%	-0.01%
过去三年	2.57%	1.17%	1.49%	1.05%	1.08%	0.12%
自基金合同生效起至今	10.98%	1.18%	-3.72%	1.06%	14.70%	0.12%

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

摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011 年 1 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2011 年 1 月 30 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

本基金建仓期为本基金合同生效日起 6 个月，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根基金管理（中国）有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51% 股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49% 股权转让给摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)，从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2023 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有八十七只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券

投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金(QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根研究驱动股票型证券投资基金、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、摩根行业睿选股股票型证券投资基金、摩根优势成长混合型证券投资基金、摩根安荣回报混合型证券投资基金、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型证券投资基金、摩根均衡优选混合型证券投资基金、摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、摩根月月盈 30 天滚动

持有发起式短债债券型证券投资基金、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、摩根全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金、摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根锦颐养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、摩根海外稳健配置混合型证券投资基金(QDII-FOF)、摩根时代睿选股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
张军	本基金基金经理	2021-06-01	-	19 年（金融领域从业经验 30 年）	张军先生曾任上海国际信托有限公司国际业务部经理、交易部经理。2004 年 6 月起加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），先后担任交易部总监、基金经理、投资绩效评估总监、国际投资部总监、组合基金投资部总监，现任高级基金经理。
薛晓敏	本基金基金经理助理	2022-09-01	-	14 年	暨南大学计算机软件与理论硕士，现任国际投资部基金经理助理。薛晓敏先生自 2007 年 7 月至 2009 年 5 月在恒生电子股份有限公司担任软件工程师；自 2009 年 5 月至 2014 年 11 月在国海富兰克林基金管理有限公司担任数量分析师；自 2014 年 11 月加入摩根基金管理（中国）有限公司（原“上投摩根基金管理有限公司”），历任研究员、投资经理助理、投资经理，现任国际投资部基

					金经理助理。
--	--	--	--	--	--------

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
张军	公募基金	9	4,871,195,936.95	2008-03-08
	私募资产管理计划	1	51,730,995.32	2021-07-09
	其他组合	-	-	-
	合计	10	4,922,926,932.27	

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

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Anuj Arora	摩根资产管理(英国)董事总经理，位于伦敦的新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队的负责人	20 年	Anuj Arora，董事总经理，是位于伦敦的新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队的负责人。自 2006 年加入公司以来，负责管理全球新兴市场多元策略，并监督 EMAP 股票团队中与量化策略有关的所有研究，包括资产配置和风险管理。此前，Anuj 是芝加哥梅斯洛金融公司的定量分析师和 Birkelbach Investment Securities 的分析师。他拥有伊利诺伊理工学院金融学硕士学位。
Harold Yu	摩根资产管理(英国)副总裁，产品分析师	11 年	Harold Yu，特许金融分析师，副总裁，是一位产品分析师，负责位于伦敦的新兴市场和亚太地区（EMAP）股票团队的全球新兴市场核心策略。他于 2014 年 2 月加入公司，在此之前，在英杰华投资从事股票衍生品业务。Harold 于 2011 年获得了格林内尔学院（Grinnell College）数学和经济学学士学位并于 2013 年获得康奈尔大学金融工程专业的硕士学位。Harold 拥有金融风险管理师（FRM）证书，并且是特许金融分析师。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规

定。除以下情况外，基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求：本基金曾出现个别由于市场原因引起的投资组合的投资指标被动偏离相关比例要求的情形，但已在规定时间内调整完毕。

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

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：无。

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

全球新兴市场股市在 2023 年一季度上涨，涨幅略低于成熟市场股市，然而亚洲新兴市场股市涨幅略高于成熟市场股市。涨幅居前的市场有墨西哥和中国台湾，行业有信息技术，通讯服务等。表现落后的市场有印度，行业有公用事业和医疗等。2023 年开局的 1 月份，受到弱美元和中国重新开放的支持，新兴市场股市表现强劲。到 2 月时，中美关系再度紧张以及对美联储加息进程的重新评

估，导致避险情绪抬升，新兴市场股市下跌。大宗商品价格疲软也拖累新兴市场。3 月上旬发生的美国两家区域性银行的风险事件再次拖累股价下跌，好在恐慌情绪没有长时间蔓延，市场于 3 月下旬企稳回升。在 4 月和 5 月期间，影响股指下跌的主要因素是中国复苏低于预期导致的下跌。进入 6 月，在美联储暂停加息的预期下，新兴市场股市随成熟市场股市反弹，但是涨幅弱于成熟市场。下半月，美联储主席对外言论被解读为尚有 2 次加息可能，且中国的刺激经济措施不如预期，市场又开始回落。

报告期内涨幅领先的新兴市场是匈牙利、波兰和希腊，领先的行业是能源、金融和信息技术。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根全球新兴市场份额净值增长率为:9.60%，同期业绩比较基准收益率为:7.34%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，2023 年新兴市场在美国经济衰退被市场消化之前仍需要谨慎。市场仍然具有宏观脆弱性，增长预测低于趋势，因为美国联邦基金利率已达到 5%，预计 2023 年美国将陷入衰退。这将意味着新兴市场面临挑战，但之后可能会出现拐点。随着通胀见顶，各国央行有望结束加息周期。

2023 年新兴市场经济预计增长 2.9%，仍将远低于疫情前的趋势。新兴市场（中国除外）预计将放缓至低于趋势水平的 1.8%，各新兴市场间差异很大。我们预计中国 2023 年全年经济增长 4.0%。2022 年的地缘政治压力仍未解决，仍然是 2023 年新兴市场的风险，同时下半年还有一些关键的政治事件引人注目，如阿根廷的选举。

我们期待新兴市场到 2023 年底，除中国和土耳其外的通货膨胀率将减半至 4.3%。然而，一些新兴市场央行明年可能会开始宽松，但大多数看起来将在更长时间内保持高利率。

我们关注在 2023 年的 3 个主要可能情形：（1）中国将可能成为唯一一个在 2023 年加速增长的大型经济体；（2）美元和美国利率的见顶；及（3）全球资金对新兴市场低配及估值过低，股票有可能维持相对于成熟市场的正回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事

项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

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

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2023 年 01 月 03 日至 2023 年 06 月 12 日。

基金管理人拟调整本基金运作方式，加大营销力度，提升基金规模，方案已报监管机关。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

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：摩根全球新兴市场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	7,377,455.66	6,110,778.37
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	42,675,141.54	37,722,529.74
其中：股票投资		41,664,685.67	37,722,529.74
基金投资		1,010,455.87	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	56.77
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		403,228.62	256,800.07
应收申购款		140,711.00	35,692.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		50,596,536.82	44,125,857.47
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		1.94	2.07
应付赎回款		1,005,855.36	233,897.52
应付管理人报酬		72,801.61	67,888.62
应付托管费		14,155.86	13,200.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	111,446.82	195,247.94
负债合计		1,204,261.59	510,236.70
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	48,393,591.26	46,835,784.18
未分配利润	6.4.7.8	998,683.97	-3,220,163.41
净资产合计		49,392,275.23	43,615,620.77
负债和净资产总计		50,596,536.82	44,125,857.47

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日,基金份额净值:1.0206 元,基金份额总额:48,393,591.26 份。

6.2 利润表

会计主体：摩根全球新兴市场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		4,876,261.53	-7,114,274.33
1.利息收入		13,604.90	4,599.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,604.90	4,599.88
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）		-674,611.41	-2,583,072.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,624,504.02	-3,465,386.24
基金投资收益	6.4.7.11	-440.09	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	97.59	-
股利收益	6.4.7.14	950,235.11	882,313.99
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	5,544,477.13	-4,642,454.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-13,233.43	99,767.75
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,024.34	6,884.97
减：二、营业总支出		554,003.70	571,680.37
1. 管理人报酬		411,665.91	416,193.69
2. 托管费		80,046.15	80,926.53
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.36	-
8. 其他费用		62,291.28	74,560.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,322,257.83	-7,685,954.70

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,322,257.83	-7,685,954.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,322,257.83	-7,685,954.70

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：摩根全球新兴市场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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	46,835,784.18	-	-3,220,163.41	43,615,620.77
二、本期期初净资产（基金净值）	46,835,784.18	-	-3,220,163.41	43,615,620.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,557,807.08	-	4,218,847.38	5,776,654.46
（一）、综合收益总额	-	-	4,322,257.83	4,322,257.83
（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）	1,557,807.08	-	-103,410.45	1,454,396.63
其中：1.基金申购款	7,651,743.50	-	-260,718.92	7,391,024.58
2.基金赎回款	-6,093,936.42	-	157,308.47	-5,936,627.95
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	48,393,591.26	-	998,683.97	49,392,275.23
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（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	43,942,748.38	-	9,301,181.13	53,243,929.51

产（基金净值）				
二、本期期初净资产（基金净值）	43,942,748.38	-	9,301,181.13	53,243,929.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,589,893.67	-	-11,860,184.65	-10,270,290.98
（一）、综合收益总额	-	-	-7,685,954.70	-7,685,954.70
（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）	1,589,893.67	-	145,038.71	1,734,932.38
其中：1.基金申购款	7,838,059.37	-	315,563.16	8,153,622.53
2.基金赎回款	-6,248,165.70	-	-170,524.45	-6,418,690.15
（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）	-	-	-4,319,268.66	-4,319,268.66
四、本期期末净资产（基金净值）	45,532,642.05	-	-2,559,003.52	42,973,638.53

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：

基金管理人负责人：王琮慧，主管会计工作负责人：王敏，会计机构负责人：俞文涵

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)(原名为上投摩根全球新兴市场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[2010]1277 号《关于核准上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金募集的批复》核准，由摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司，已于 2023 年 4 月 10 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《上投摩根全球新兴市场股票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 349,520,284.05 元，业经普华永道中天会计师

事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 048 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 349,551,403.11 份基金份额,其中认购资金利息折合 31,119.06 份基金份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行,境外投资顾问为摩根资产管理(英国)有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,上投摩根全球新兴市场股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 21 日公告后更名为上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金。

根据摩根基金管理(中国)有限公司 2023 年 4 月 12 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》,本基金管理人的中文法定名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理(中国)有限公司”。根据同一天发布的《摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金自该日起更名为摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为与中国证监会签署备忘录的新兴国家或地区的证券。本基金拟投资的新兴市场主要根据摩根斯坦利新兴市场指数所包含的国家或地区进行界定,主要包括:中国、巴西、韩国、台湾、印度、南非、俄罗斯、墨西哥、以色列、马来西亚、印度尼西亚、智利、土耳其、泰国、波兰、哥伦比亚、匈牙利、秘鲁、埃及、捷克、菲律宾、摩洛哥等国家或地区。如果摩根斯坦利新兴市场指数所包含的国家或地区增加、减少或变更,本基金投资的主要证券市场将相应调整。本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的 60%-95%,现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的 5%-40%,并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。本基金的业绩比较基准为:摩根斯坦利新兴市场股票指数(总回报)。

本财务报表由本基金的基金管理人摩根基金管理(中国)有限公司于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

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》、《摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年度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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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[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。

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费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	7,377,455.66
等于：本金	7,376,930.15
加：应计利息	525.51
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	7,377,455.66

注：于 2023 年 6 月 30 日，活期银行存款中包含的外币余额为：美元 237,305.91 元(折合人民币 1,714,725.04 元)，港币 138.71 元(折合人民币 127.90 元)，新台币 233,170.00 元(折合人民币 54,097.51 元)，韩元 1,153.00 元(折合人民币 6.32 元)，福林 670.00 元(折合人民币 14.16 元)，欧元 0.52 元(折合人民币 4.10 元)，卢布 1,748,157.26 元(折合人民币 141,137.82 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		40,672,983.53	-	41,664,685.67	991,702.14
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		877,978.75	-	1,010,455.87	132,477.12
其他		-	-	-	-
合计		41,550,962.28	-	42,675,141.54	1,124,179.26

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

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 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	2,376.29
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,540.74
其中：交易所市场	4,540.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,529.79
合计	111,446.82

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,835,784.18	46,835,784.18
本期申购	7,651,743.50	7,651,743.50
本期赎回（以“-”号填列）	-6,093,936.42	-6,093,936.42
本期末	48,393,591.26	48,393,591.26

注：申购含转换入份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,396,963.58	1,176,800.17	-3,220,163.41
本期利润	-1,222,219.30	5,544,477.13	4,322,257.83
本期基金份额交易产生的变动数	-388,707.99	285,297.54	-103,410.45
其中：基金申购款	-1,855,360.27	1,594,641.35	-260,718.92
基金赎回款	1,466,652.28	-1,309,343.81	157,308.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,007,890.87	7,006,574.84	998,683.97

6.4.7.9 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	13,352.02
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	251.50
其他	1.38
合计	13,604.90

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,829,948.06
减：卖出股票成本总额	14,402,150.60
减：交易费用	52,301.48
买卖股票差价收入	-1,624,504.02

6.4.7.11 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	440.09
基金投资收益	-440.09

6.4.7.12 债券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出权证成交总额	100.63
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	0.11
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	2.93
买卖权证差价收入	97.59

6.4.7.14 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	948,593.26
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,641.85
合计	950,235.11

6.4.7.15 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	5,544,533.90
——股票投资	5,412,056.78
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	132,477.12
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-56.77
——权证投资	-56.77
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	5,544,477.13

6.4.7.16 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	6,024.34
合计	6,024.34

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

6.4.7.17 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	24,734.60
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
其他	11,616.49
银行费用	1,145.00
合计	62,291.28

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

根据中国证监会证监许可(2023)151 号《关于核准上投摩根基金管理有限公司变更股东、实际控制人的批复》，核准摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)成为上投摩根基金管理有限公司主要股东；核准摩根大通公司(JPMorgan Chase &Co.)成为上投摩根基金管理有限公司实际控制人；对摩根资产管理控股公司依法受让上投摩根基金管理有限公司 2.5 亿元出资(占注册资本比例 100%)无异议。相关股权变更工商变更手续于 2023 年 3 月 24 日完成。公司股东由摩根资产管理(英国)有限公司及上海浦东发展银行股份有限公司变更为摩根资产管理控股公司。

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
摩根基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
摩根大通银行(JPMorgan & Chase Bank, N.A.)	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

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	411,665.91	416,193.69
其中：支付销售机构的客户维护费	131,919.89	132,530.21

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8%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 X 1.8% / 当年天数。

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	80,046.15	80,926.53

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%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 X 0.35% / 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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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		上年度可比期间 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
中国建设银行股份有限公司	5,468,389.18	6,800.71	1,632,460.46	3,736.41
摩根大通银行	1,909,066.48	6,551.31-	1,818,223.37	0.32

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

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

本基金本报告期内未持有基金管理人以及管理人关联方所管理的基金。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未实施利润分配。

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为区域性混合型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于债券型基金和平衡型基金。由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。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从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责建立并完善公司市场风险、流动性风险、信用风险管理框架，运用系统化分析工具对以上进行分析和识别，提升公司风险科技水平。运营风险管理部负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。投资准则管理部负责执行和管控投资准则，通过设立投资准则、事前管控、事后管控，保障基金投资运作符合法规、合同及公司内部要求。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估

测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行以及境外次托管行摩根大通银行，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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

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(所有者权益)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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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%(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该比例限制),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%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,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%。

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。

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。

6.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民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	港币 折合人民币	(其他主要 币种) 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价					

的资产					
银行存款	1,714,725.04	127.90	-	195,259.91	1,910,112.85
交易性金融资产	11,089,773.64	11,966,123.42	-	19,619,244.48	42,675,141.54
应收股利	39,254.09	148,579.17	-	215,395.36	403,228.62
资产合计	12,843,752.77	12,114,830.49	-	20,029,899.75	44,988,483.01
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	12,843,752.77	12,114,830.49	-	20,029,899.75	44,988,483.01
项目	上年度末				
	2022 年 12 月 31 日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	(其他主要 币种) 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	1,725,006.34	105,185.28	-	492,741.59	2,322,933.21
交易性金融资产	7,530,472.84	12,956,408.26	-	17,235,648.64	37,722,529.74
衍生金融资产	-	-	-	56.77	56.77
应收股利	36,521.04	4,023.84	-	212,295.19	252,840.07
资产合计	9,292,000.22	13,065,617.38	-	17,940,742.19	40,298,359.79
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	9,292,000.22	13,065,617.38	-	17,940,742.19	40,298,359.79

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 225	增加约 201
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 225	减少约 201

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衍生工具，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，采用“自上而下”的策略，首先通过考察不同国家的发展趋势及不同行业的景气程度，决定地区与板块的基本布局；其次采取“自下而上”的选股策略，在对股票进行基本面分析的同时，通过深入研究股票的价值与动量特性，选取目标投资对象。在固定收益类投资部分，本基金将综合考虑资产布局的安全性、流动性与收益性，并结合现金管理要求等来制订具体策略。

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及其它权益类证券市值占基金资产的 60%-95%，现金、债券及中国证监会允许投资的其它金融工具市值占基金资产的 5%-40%。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	41,664,685.67	84.35	37,722,529.74	86.49
交易性金融资产—基金投资	1,010,455.87	2.05	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	56.77	0.00
其他	-	-	-	-
合计	42,675,141.54	86.40	37,722,586.51	86.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	摩根斯坦利新兴市场股票指数(总回报)上升 5%	增加约 241	增加约 216
	摩根斯坦利新兴市场股票指数(总回报)下降 5%	减少约 241	减少约 216

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	42,675,141.54	37,722,529.74
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	42,675,141.54	37,722,529.74

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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	41,664,685.67	82.35
	其中：普通股	32,545,098.55	64.32
	存托凭证	9,119,587.12	18.02
	优先股	-	-

	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	1,010,455.87	2.00
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	7,377,455.66	14.58
8	其他各项资产	543,939.62	1.08
9	合计	50,596,536.82	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,783,197.52 元,占净值比例 17.78%。

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（%）
中国香港	11,966,123.42	24.23
美国	9,066,436.20	18.36
韩国	6,581,246.06	13.32
巴西	3,295,152.30	6.67
南非	2,330,412.16	4.72
中国台湾	1,871,406.70	3.79
英国	1,461,317.45	2.96
俄罗斯	1,254,258.12	2.54
墨西哥	1,011,717.56	2.05
波兰	675,175.55	1.37
印度尼西亚	660,601.02	1.34
泰国	601,407.48	1.22
智利	287,539.75	0.58
希腊	253,370.95	0.51
马来西亚	189,569.08	0.38
匈牙利	158,951.87	0.32
合计	41,664,685.67	84.35

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

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（%）
金融	10,868,309.60	22.00
信息技术	8,620,103.88	17.45
消费者非必需品	4,872,003.53	9.86
电信服务	4,607,469.91	9.33
能源	3,879,051.75	7.85
消费者常用品	3,124,104.62	6.33
工业	2,861,349.42	5.79
基础材料	1,598,472.20	3.24
公用事业	776,374.73	1.57
医疗保健	457,446.03	0.93
合计	41,664,685.67	84.35

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	Taiwan Semicond uctor Manufact uring Co Ltd	台积电	TSM	纽约证 券交易 所	美国	4,910	3,580,508.18	7.25
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	00700	香港证 券交易 所	中国香港	8,000	2,446,035.56	4.95
3	Samsung Electronic s Co Ltd	三星电子 有限公司	005930	韩国证 券交易 所	韩国	5,638	2,232,277.28	4.52
4	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	09988	香港证 券交易 所	中国香港	19,100	1,430,038.25	2.90

5	HDFC Bank Ltd	HDFC 银行有限公司	HDB	纽约证券交易所	美国	2,310	1,163,404.38	2.36
6	Reliance Industries Ltd	印度信实工业公司	RIGD	伦敦国际金融中心交易所	英国	2,195	988,117.31	2.00
7	NetEase Inc	网易	09999	香港证券交易所	中国香港	6,100	858,306.94	1.74
8	SK Hynix Inc	SK 海力士株式会社	000660	韩国证券交易所	韩国	1,315	830,738.05	1.68
9	Petroleo Brasileiro SA	巴西石油公司	PETR4	巴西交易所	巴西	16,628	735,499.02	1.49
10	Yum China Holdings Inc	百胜中国	YUMC	纽约证券交易所	美国	1,753	715,675.75	1.45
11	ICICI BANK LTD-SPO N ADR	ICICI BANK LTD-SPON ADR	IBN	纽约证券交易所	美国	4,205	701,274.01	1.42
12	KIA CORP	KIA CORP	000270	韩国证券交易所	韩国	1,340	650,330.23	1.32
13	Ping An Insurance(Group)Company of China	中国平安	02318	香港证券交易所	中国香港	14,000	643,504.30	1.30
14	JD.COM INC-CLASS A	JD.COM INC-CLASS A	09618	香港证券交易所	中国香港	5,250	640,922.54	1.30
15	China National Petroleum Corporation	中国石油股份	00857	香港证券交易所	中国香港	120,000	599,706.55	1.21
16	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	BBAS3	巴西交易所	巴西	7,556	559,110.36	1.13
17	China Merchants	招商银行	03968	香港证券交易所	中国香港	17,000	558,029.52	1.13

	Bank			所				
18	Picc Property And Casualty Company Limited	中国财险	02328	香港证券交易所	中国香港	68,000	546,116.53	1.11
19	FIRSTRAND LTD	FIRSTRAND LTD	FSR	南非证券交易所	南非	20,650	541,048.09	1.10
20	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒股份	00168	香港证券交易所	中国香港	8,000	525,204.26	1.06
21	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	SBER	莫斯科证券交易所	俄罗斯	26,740	518,989.73	1.05
22	AMERICA MOVIL SAB DE CV ADR	AMERICA MOVIL SAB DE CV ADR	AMX	纽约证券交易所	美国	3,291	514,601.53	1.04
23	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	055550	韩国证券交易所	韩国	2,690	501,553.27	1.02
24	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	GFNORTEO	墨西哥交易所	墨西哥	8,260	491,422.06	0.99
25	China Pacific Insurance(group) Co.,Ltd.	中国太保	02601	香港证券交易所	中国香港	26,000	485,463.56	0.98
26	CREDICORP LTD	CREDICORP LTD	BAP	纽约证券交易所	美国	428	456,597.72	0.92
27	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	3034	台湾交易所	中国台湾	4,000	395,807.12	0.80

	NICS COR							
28	LUKOIL OAO	LUKOIL OAO	LKOH	莫斯科 证券交 易所	俄罗斯	937	386,906.19	0.78
29	TELKOM INDONE SIA PERSER O TBK	TELKOM INDONESI A PERSERO TBK	TLKM	印度尼 西亚交 易所	印度尼西 亚	189,700	365,711.99	0.74
30	PTT EXPLOR & PROD PCL NVDR	PTT EXPLOR & PROD PCL NVDR	PTTEP-R	泰国证 券交易 所	泰国	11,900	363,786.57	0.74
31	WEG SA	WEG SA	WEGE3	巴西交 易所	巴西	6,426	363,359.33	0.74
32	HANA FINANCI AL GROUP	HANA FINANCIA L GROUP	086790	韩国证 券交易 所	韩国	1,642	352,975.93	0.71
33	GAZPRO M PJSC	GAZPRO M PJSC	GAZP	莫斯科 证券交 易所	俄罗斯	25,742	348,362.20	0.71
34	PDD HOLDIN GS INC	PDD HOLDING S INC	PDD	纳斯达 克交易 所	美国	672	335,725.70	0.68
35	AMBEV SA-ADR	AMBEV SA-ADR	ABEV	纽约证 券交易 所	美国	13,948	320,497.76	0.65
36	BANK PEKAO SA	BANK PEKAO SA	PEO	华沙证 券交易 所	波兰	1,531	301,688.95	0.61
37	ANGLO AMERIC AN PLC	ANGLO AMERICA N PLC	AAL	英国伦 敦交易 所	英国	1,470	301,548.46	0.61
38	WISTRO N CORP	WISTRON CORP	3231	台湾交 易所	中国台湾	14,000	294,929.67	0.60
39	LG CHEM LTD	LG CHEM LTD	051910	韩国证 券交易 所	韩国	80	292,618.44	0.59
40	SHOPRIT E HOLDIN GS LTD	SHOPRITE HOLDING S LTD	SHP	南非证 券交易 所	南非	3,357	289,678.11	0.59

41	Jiangxi Copper Company Limited	江西铜业 股份	00358	香港证 券交易 所	中国香港	26,000	288,641.05	0.58
42	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	2376	台湾交 易所	中国台湾	5,000	282,470.79	0.57
43	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	BBSE3	巴西交 易所	巴西	6,002	276,631.81	0.56
44	Dongfang Electric Corporation Limited	东方电气	01072	香港证 券交易 所	中国香港	29,000	267,931.62	0.54
45	Zhuzhou Crrc Times Electric Co.,Ltd.	时代电气	03898	香港证 券交易 所	中国香港	9,600	258,471.31	0.52
46	CIA ENERG ADR REPR 1 NV PREF SHS	CIA ENERG ADR REPR 1 NV PREF SHS	CIG	纽约证 券交易 所	美国	13,352	253,739.46	0.51
47	ZTO EXPRESSES CAYMAN INC	ZTO EXPRESS CAYMAN INC	02057	香港证 券交易 所	中国香港	1,400	253,658.17	0.51
48	Haier Smart Home Co.,Ltd.	海尔智家	06690	香港证 券交易 所	中国香港	11,000	250,016.04	0.51
49	Absa Group Ltd	Absa Group Ltd	ABG	南非证 券交易 所	南非	3,715	238,594.61	0.48
50	KRUNG THAI BANK	KRUNG THAI BANK	KTB-R	泰国证 券交易 所	泰国	60,100	237,620.91	0.48

	PCL NVDR	PCL NVDR						
51	UNITED MICROE LECTRO NICS CORP	UNITED MICROE LECTRONI CS CORP	2303	台湾交 易所	中国台湾	20,000	225,048.60	0.46
52	EDP - ENERGI AS DO BRASIL SA	EDP - ENERGIA S DO BRASIL SA	ENBR3	巴西交 易所	巴西	6,246	220,983.84	0.45
53	RAIA DROGAS IL SA	RAIA DROGASI L SA	RADL3	巴西交 易所	巴西	4,787	212,243.20	0.43
54	China Railway Group Limited	中国中铁	00390	香港证 券交易 所	中国香港	44,000	209,749.76	0.42
55	DINO POLSKA SA	DINO POLSKA SA	DNP	华沙证 券交易 所	波兰	246	207,725.72	0.42
56	ARCA CONTIN ENTAL SAB DE CV	ARCA CONTINE NTAL SAB DE CV	AC*	墨西哥 交易所	墨西哥	2,759	204,515.13	0.41
57	AIA Group Limited	友邦保险	01299	香港证 券交易 所	中国香港	2,800	204,217.41	0.41
58	STANDA RD BANK GROUP LTD	STANDAR D BANK GROUP LTD	SBK	南非证 券交易 所	南非	2,937	199,457.27	0.40
59	VIPSHOP HOLDIN GS LTD - ADR	VIPSHOP HOLDING S LTD - ADR	VIPS	纽约证 券交易 所	美国	1,666	198,630.02	0.40
60	CIMB GROUP HOLDIN GS BHD	CIMB GROUP HOLDING S BHD	CIMB	马来西 亚证券 交易所	马来西亚	24,200	189,569.08	0.38
61	GF SECURIT	广发证券	01776	香港证 券交易	中国香港	19,000	189,556.69	0.38

	IES CO., LTD.			所				
62	3SBio Inc.	三生制药	01530	香港证券交易所	中国香港	25,000	181,414.92	0.37
63	Sinotrans Limited	中国外运	00598	香港证券交易所	中国香港	70,000	180,077.93	0.36
64	ARCOS DORADOS HOLDINGS INC-A	ARCOS DORADOS HOLDINGS INC-A	ARCO	纽约证券交易所	美国	2,389	176,939.97	0.36
65	China Citic Bank Corporation Limited	中信银行	00998	香港证券交易所	中国香港	52,000	176,445.03	0.36
66	Meituan	美团-W	03690	香港证券交易所	中国香港	1,550	174,789.93	0.35
67	MTN GROUP LTD	MTN GROUP LTD	MTN	南非证券交易所	南非	3,302	174,483.03	0.35
68	Sinopharm Group Co., Ltd.	国药控股	01099	香港证券交易所	中国香港	7,600	171,687.21	0.35
69	Kunlun Energy Company Limited	昆仑能源	00135	香港证券交易所	中国香港	30,000	170,396.32	0.34
70	GPO AEROPORT DEL PACIFICO - B SH	GPO AEROPORT DEL PACIFICO - B SH	GAPB	墨西哥交易所	墨西哥	1,315	170,215.27	0.34
71	INFOSYS LTD-SP ADR	INFOSYS LTD-SP ADR	INFY	纽约证券交易所	美国	1,443	167,559.15	0.34
72	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIEC	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIEC	PZU	华沙证券交易所	波兰	2,365	165,760.88	0.34

	CZE	ZE						
73	S-OIL CORP	S-OIL CORP	010950	韩国证 券交易 所	韩国	449	164,232.10	0.33
74	MICRO-S TAR INTERN ATIONA L CO	MICRO-ST AR INTERNA TIONAL CO	2377	台湾交 易所	中国台湾	4,000	163,798.26	0.33
75	ACCTON TECHNO LOGY CORP	ACCTON TECHNOL OGY CORP	2345	台湾交 易所	中国台湾	2,000	161,942.19	0.33
76	BANK MANDIR I PERSER O TBK PT	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	BMRI	印度尼 西亚交 易所	印度尼西 亚	64,400	161,399.09	0.33
77	SAMSUN G ELECTR O-MECH ANICS CO	SAMSUN G ELECTRO -MECHAN ICS CO	009150	韩国证 券交易 所	韩国	201	159,275.79	0.32
78	MOL HUNGA RIAN OIL AND GAS PL	MOL HUNGARI AN OIL AND GAS PL	MOL	匈牙利 证券交 易所	匈牙利	2,517	158,951.87	0.32
79	SLC AGRICO LA SA	SLC AGRICOL A SA	SLCE3	巴西交 易所	巴西	2,764	158,236.75	0.32
80	CENCOS UD SA	CENCOSU D SA	CENCOSUD	圣地亚 哥证券 交易所	智利	11,275	157,822.88	0.32
81	BANCO SANTAN DER-CHI LE-ADR	BANCO SANTAND ER-CHILE -ADR	BSAC	纽约证 券交易 所	美国	1,157	157,590.72	0.32
82	VALE SA	VALE SA	VALE3	巴西交 易所	巴西	1,634	157,181.34	0.32
83	SAMSUN G FIRE & MARINE	SAMSUN G FIRE & MARINE	000810	韩国证 券交易 所	韩国	123	155,138.22	0.31

	INS	INS						
84	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION	HTO	希腊交易所	希腊	1,200	148,616.87	0.30
85	CMOC Group Limited	洛阳钼业	03993	香港证券交易所	中国香港	39,000	147,437.08	0.30
86	BGF RETAIL CO LTD	BGF RETAIL CO LTD	282330	韩国证券交易所	韩国	153	146,746.28	0.30
87	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-E-B	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-E-B	ASURB	墨西哥交易所	墨西哥	724	145,565.10	0.29
88	CLICKS GROUP LTD	CLICKS GROUP LTD	CLS	南非证券交易所	南非	1,440	143,916.48	0.29
89	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	086280	韩国证券交易所	韩国	132	143,108.84	0.29
90	ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	271560	韩国证券交易所	韩国	217	142,799.55	0.29
91	PORTO SEGURO SA	PORTO SEGURO SA	PSSA3	巴西交易所	巴西	3,390	142,788.64	0.29
92	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1216	台湾交易所	中国台湾	8,000	141,618.21	0.29
93	COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR	COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR	KOF	纽约证券交易所	美国	228	137,251.76	0.28
94	DB INSURA	DB INSURAN	005830	韩国证券交易所	韩国	335	137,046.99	0.28

	NCE CO LTD	CE CO LTD		所				
95	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	024110	韩国证券交易所	韩国	2,389	135,463.58	0.27
96	BIDVEST GROUP LTD	BIDVEST GROUP LTD	BVT	南非证券交易所	南非	1,349	134,997.19	0.27
97	UNITED TRACTORS TBK PT	UNITED TRACTORS TBK PT	UNTR	印度尼西亚交易所	印度尼西亚	11,900	133,489.94	0.27
98	WNS HOLDINGS LTD-ADR	WNS HOLDINGS LTD-ADR	WNS	纽约证券交易所	美国	248	132,106.12	0.27
99	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	SBSP3	巴西交易所	巴西	1,549	131,255.11	0.27
100	BANCO DE CHILE	BANCO DE CHILE	CHILE	圣地亚哥证券交易所	智利	172,065	129,716.87	0.26
101	BID CORP LTD	BID CORP LTD	BID	南非证券交易所	南非	804	127,097.26	0.26
102	ASIA VITAL COMPONENTS	ASIA VITAL COMPONENTS	3017	台湾交易所	中国台湾	2,000	125,748.80	0.25
103	SANLAM LTD	SANLAM LTD	SLM	南非证券交易所	南非	5,630	125,653.47	0.25
104	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	WHL	南非证券交易所	南非	4,567	124,637.93	0.25
105	GERDAU SA-PREF	GERDAU SA-PREF	GGBR4	巴西交易所	巴西	3,202	120,241.48	0.24
106	KUMHO PETROC	KUMHO PETROCH	011780	韩国证券交易所	韩国	163	118,616.31	0.24

	HEMICAL CO LTD	EMICAL CO LTD		所				
107	LOCALIZA RENT A CAR	LOCALIZA RENT A CAR	RENT3	巴西交易所	巴西	1,142	117,175.09	0.24
108	GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	006360	韩国证券交易所	韩国	1,111	113,565.35	0.23
109	YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD.	颐海国际	01579	香港证券交易所	中国香港	7,000	108,304.94	0.22
110	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	TRU	南非证券交易所	南非	4,910	106,297.53	0.22
111	SAMSUNG C&T CORP	SAMSUNG C&T CORP	028260	韩国证券交易所	韩国	180	104,335.80	0.21
112	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	ASAI3	巴西交易所	巴西	4,877	100,446.33	0.20
113	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	ARI	南非证券交易所	南非	1,317	100,250.35	0.20
114	AIRTEL AFRICA PLC	AIRTEL AFRICA PLC	AAF	英国伦敦交易所	英国	10,069	99,713.99	0.20
115	PAN OCEAN CO LTD (KR LIST)	PAN OCEAN CO LTD (KR LIST)	028670	韩国证券交易所	韩国	3,401	96,610.04	0.20
116	PEGAVISION	PEGAVISION CORP	6491	台湾交易所	中国台湾	1,000	80,043.06	0.16

	CORP							
117	MYTILIN EOS S.A.	MYTILIN EOS S.A.	MYTIL	希腊交 易所	希腊	233	59,402.76	0.12
118	COPA HOLDIN GS SA-CLAS S A	COPA HOLDING S SA-CLASS A	CPA	纽约证 券交易 所	美国	68	54,333.97	0.11
119	RIO TINTO PLC	RIO TINTO PLC	RIO	英国伦 敦交易 所	英国	103	47,173.43	0.10
120	OPAP SA	OPAP SA	OPAP	希腊交 易所	希腊	360	45,351.32	0.09
121	POSCO INTERN ATIONA L CORP	POSCO INTERNA TIONAL CORP	047050	韩国证 券交易 所	韩国	155	33,872.39	0.07
122	SAMSUN G SECURIT IES CO LTD	SAMSUN G SECURITI ES CO LTD	016360	韩国证 券交易 所	韩国	124	24,479.92	0.05
123	MAGNIT OGORS- SPON GDR REGS	MAGNITO GORS-SP ON GDR REGS	MMK	伦敦国 际金融 交易所	英国	1,684	24,336.49	0.05
124	ASPEN PHARM ACARE HOLDIN GS LT	ASPEN PHARMA CARE HOLDING S LT	APN	南非证 券交易 所	南非	346	24,300.84	0.05
125	SAMSUN G ENGINE ERING CO LTD	SAMSUN G ENGINEE RING CO LTD	028050	韩国证 券交易 所	韩国	147	22,813.38	0.05
126	HYUND AI MOTOR CO	HYUNDAI MOTOR CO	005380	韩国证 券交易 所	韩国	20	22,648.32	0.05
127	SEVERST AL GDR REGS	SEVERST AL GDR REGS	SVST	伦敦国 际金融 交易所	英国	985	427.77	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	02318	709,624.78	1.63
2	China Pacific Insurance(group) Co.,Ltd.	02601	680,341.46	1.56
3	Dongfang Electric Corporation Limited	01072	532,971.71	1.22
4	PDD HOLDINGS INC	PDD	530,860.08	1.22
5	YUM CHINA HOLDINGS INC	YUMC	491,593.50	1.13
6	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	3034	357,630.09	0.82
7	COPA HOLDINGS SA-CLASS A	CPA	338,622.46	0.78
8	WEG SA	WEGE3	327,659.64	0.75
9	Jiangxi Copper Company Limited	00358	305,482.95	0.70
10	ZTO EXPRESS CAYMAN INC	02057	274,200.68	0.63
11	Tsingtao Brewery Company Limited	00168	271,760.67	0.62
12	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	PZU	240,880.05	0.55
13	China Citic Bank Corporation Limited	00998	240,316.95	0.55
14	LG CHEM LTD	051910	236,968.42	0.54
15	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	BMRI	236,641.03	0.54
16	UNITED MICROELECTRONICS CORP	2303	222,611.92	0.51
17	BANK PEKAO SA	PEO	218,825.47	0.50
18	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	KTBR	208,432.85	0.48
19	VALE SA	VALE3	204,288.32	0.47
20	Gf Securities Co.,Ltd.	01776	202,387.26	0.46

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成

交单价乘以成交数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位: 人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计卖出 金额	占期初基金 资产净值比例 (%)
1	POSCO HOLDINGS INC	005490	500,346.54	1.15
2	Lenovo Group Limited	00992	472,470.56	1.08
3	Meituan	03690	453,319.25	1.04
4	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	WALMEX *	446,981.65	1.02
5	LG CHEM LTD	051910	399,900.70	0.92
6	Haier Smart Home Co.,ltd.	06690	399,620.89	0.92
7	WuXi Biologics (Cayman) Inc.	02269	377,519.10	0.87
8	Guangzhou Automobile Group Co.,Ltd.	02238	374,751.51	0.86
9	COPA HOLDINGS SA-CLASS A	CPA	356,365.41	0.82
10	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	09988	319,013.10	0.73
11	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	005930	316,042.92	0.72
12	PetroChina Company Limited	00857	290,315.98	0.67
13	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	PCHEM	285,614.08	0.65
14	Picc Property And Casualty Company Limited	02328	283,974.36	0.65
15	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	3711	277,280.34	0.64
16	Longfor Group Holdings Limited	00960	277,048.80	0.64
17	RELIANCE INDS-SPON GDR	RIGD	269,398.25	0.62
18	China Pacific Insurance(group) Co.,Ltd.	02601	264,481.30	0.61
19	Dongfang Electric Corporation Limited	01072	251,344.70	0.58
20	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	PZU	246,283.62	0.56

注: “买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

7.5.3 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	12,932,249.75
卖出收入(成交) 总额	12,829,948.06

注: “买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量) 填列, 不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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	ISHARES MSCI INDIA ETF	股票型	交易型 开放式	Blackrock Fund Advisors	1,010,455.87	2.05

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	INDA UF	ISHARES MSCI INDIA ETF	交易型开 放式	3,200.00	1,010,455. 87	2.05%	否

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	403,228.62
4	应收利息	-
5	应收申购款	140,711.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	543,939.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
7,066	6,848.80	48,659.84	0.10%	48,344,931.42	99.90%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	329,866.71	0.6816%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 1 月 30 日）基金份额总额	349,551,403.11
本报告期期初基金份额总额	46,835,784.18
本报告期基金总申购份额	7,651,743.50
减：本报告期基金总赎回份额	6,093,936.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	48,393,591.26

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

2023 年 1 月，公司股东选举组成新的董事会：Daniel Watkins 先生、Paul Bateman 先生、Paul Quinsee 先生、王大智先生、汪棣先生、曾翀先生和 Matthew Bersani 先生；同时决定原董事会成员陈兵先生、陈海宁先生、林仪桥先生和周晔先生不再担任公司董事职务，刘红忠先生和王学杰先生不再担任公司独立董事职务。

2023 年 6 月，公司股东新增并选举王琼慧女士和杜猛先生出任公司董事职务。

基金管理人于 2023 年 4 月 1 日公告，自 2023 年 3 月 31 日起，刘鲁旦先生不再担任公司副总经理。

基金管理人于 2023 年 4 月 27 日公告，自 2023 年 4 月 25 日起，Daniel Watkins 先生担任公司董事长，王大智先生不再代为履行董事长职务。

基金管理人于 2023 年 6 月 30 日公告，自 2023 年 6 月 28 日起，王琼慧女士担任公司总经理、法定代表人，王大智先生不再担任公司总经理、法定代表人。

基金托管人：

无。

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、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

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

报告期内，管理人未受稽查或处罚，亦未发现管理人的高级管理人员受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人未受稽查或处罚，亦未发现托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

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	
瑞银证券	1	9,243,594.83	35.89%	12,016.68	45.70%	-
Citigroup Global Markets Ltd.	1	4,928,086.07	19.14%	3,766.54	14.32%	-
Citigroup Global Markets Taiwan Securities Company Limited	1	2,124,261.45	8.25%	2,124.60	8.08%	-
Citigroup Global Markets Korea Securities Ltd	1	1,799,990.55	6.99%	1,620.00	6.16%	-
Instinet LLC	1	1,669,583.72	6.48%	1,536.66	5.84%	-
Citigroup Global Markets Inc	1	1,603,346.80	6.23%	1,282.76	4.88%	-
Nomura Financial Investment (Korea) Co Ltd	1	1,165,257.59	4.52%	1,048.42	3.99%	-
Instinet Europe Limited	1	813,968.34	3.16%	713.39	2.71%	-
Nomura International	1	695,841.06	2.70%	696.17	2.65%	-

(Hk) Limited Taipei Branch						
Instinet Pacific Limited	1	685,495.52	2.66%	671.13	2.55%	-
CICC HK	1	527,689.65	2.05%	422.15	1.61%	-
Goldman Sachs International - London	1	497,016.39	1.93%	397.61	1.51%	-
BOCI Securities Limited	1	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limite	1	-	-	-	-	-
China Everbright Securities (HK) Li	1	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK)	1	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Ltd	1	-	-	-	-	-
CREDIT SUISSE LIMITED	1	-	-	-	-	-
Fubon Securities Company Limited	1	-	-	-	-	-
Haitong Intl Secs Co Ltd	1	-	-	-	-	-
HSBC Hong Kong	1	-	-	-	-	-
ICBC International Securities Ltd	1	-	-	-	-	-
JP Morgan Secs (Asia Pacific) Ltd	1	-	-	-	-	-
Masterlink	1	-	-	-	-	-

Securities Corp						
Merrill Lynch	1	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Corporation	1	-	-	-	-	-
SinoPac Securities Corporation	1	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 交易单元的选择标准：

1) 资本金雄厚,信誉良好。

2) 财务状况良好,经营行为规范。

3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。

4) 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
并能为本基金提供全面的信息服

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏
经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序：

1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进
行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 本报告期无新增席位，无注销席位。

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		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 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
瑞银 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigr oup Glob al Mark ets Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

Citigr oup Glob al Mark ets Taiw an Secur ities Com pany Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigr oup Glob al Mark ets Kore a Secur ities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Instin et LLC	-	-	-	-	-	-	878,418.8 4	100.00 %
Citigr oup Glob al Mark ets Inc	-	-	-	-	100.74	100.00 %	-	-
Nom ura Finan cial Inves tment (Kore a) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Instin	-	-	-	-	-	-	-	-

et Euro pe Limit ed								
Nom ura Inter natio nal (Hk) Limit ed Taipe i Bran ch	-	-	-	-	-	-	-	-
Instin et Pacifi c Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC HK	-	-	-	-	-	-	-	-
Gold man Sachs Inter natio nal - Lond on	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC I Secur ities Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB Inter natio nal Secur ities	-	-	-	-	-	-	-	-

Limit e								
Chin a Ever brigh t Secur ities (HK) Li	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Merc hants Secur ities (HK)	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI C Secur ities Brok erage (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CRE DIT SUIS SE LIMI TED	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubo n Secur ities Com pany Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Haito ng Intl Secs Co	-	-	-	-	-	-	-	-

Ltd								
HSB C Hong Kong	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC Inter natio nal Secur ities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morg an Secs (Asia Pacifi c) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Mast erlink Secur ities Corp	-	-	-	-	-	-	-	-
Merri ll Lync h	-	-	-	-	-	-	-	-
Morg an Stanl ey Corp oratio n	-	-	-	-	-	-	-	-
Sino Pac Secur ities Corp oratio n	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于上投摩根基金管理有限公司股东及实际控制人变更的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2023-01-21
2	上投摩根基金管理有限公司关于董事变更的公告	同上	2023-02-01
3	上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	同上	2023-02-17
4	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2023-04-01
5	上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	同上	2023-04-04
6	关于公司法定名称变更的公告	同上	2023-04-12
7	摩根基金管理（中国）有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	同上	2023-04-12
8	摩根基金管理（中国）有限公司关于董事长变更的公告	同上	2023-04-27
9	摩根基金管理（中国）有限公司关于深圳分公司法定名称变更的公告	同上	2023-05-13
10	摩根基金管理（中国）有限公司关于北京分公司法定名称变更的公告	同上	2023-05-19
11	摩根基金管理（中国）有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2023-06-30

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)基金合同》；
- 3、《摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)托管协议》；

- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

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。

网址：am.jpmorgan.com/cn

摩根基金管理（中国）有限公司

二〇二三年八月三十一日