

# 融通核心价值混合型证券投资基金（QDII） 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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 2021 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 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
<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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<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 中期财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	32
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.....	32
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	33
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	36

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 .....	36
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 .....	36
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 .....	36
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 .....	36
7.11 投资组合报告附注 .....	37
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	37
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 .....	37
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>38</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
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 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	38
10.4 基金投资策略的改变 .....	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	38
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 .....	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 其他重大事件 .....	40
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>41</b>
11.1 备查文件目录 .....	41
11.2 存放地点 .....	41
11.3 查阅方式 .....	41

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）
基金简称	融通核心价值混合（QDII）
基金主代码	161620
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 4 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	99,015,665.42 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755)26948088	95588
传真	(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

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

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

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

## 2.5 信息披露方式

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

## 2.6 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,721,378.75
本期利润	94,047.55
加权平均基金份额本期利润	0.0010
本期加权平均净值利润率	0.09%
本期基金份额净值增长率	7.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	17,396,255.75
期末可供分配基金份额利润	0.1757
期末基金资产净值	116,411,921.17
期末基金份额净值	1.1757
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	65.83%

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

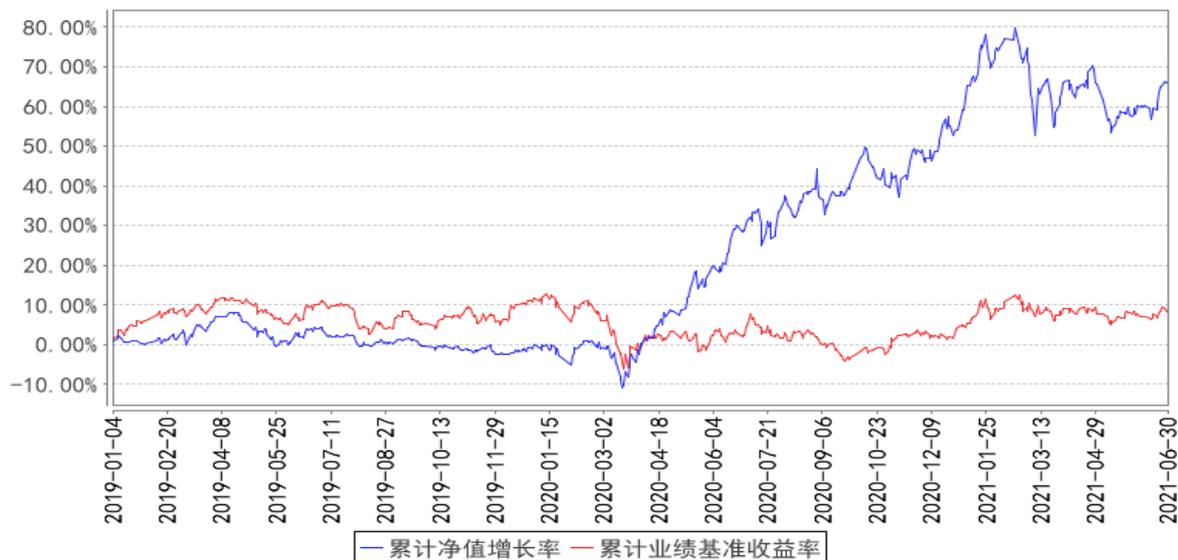
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.21%	0.77%	0.20%	0.54%	5.01%	0.23%
过去三个月	1.63%	0.99%	0.19%	0.61%	1.44%	0.38%
过去六个月	7.61%	1.39%	3.62%	0.84%	3.99%	0.55%
过去一年	28.99%	1.34%	5.50%	0.81%	23.49%	0.53%
自基金合同生效起至今	65.83%	1.10%	8.00%	0.87%	57.83%	0.23%

注:同期业绩比较基准以人民币计价。

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

融通核心价值混合（QDII）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



## § 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：新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（NikkoAssetManagementCo.,Ltd.）40%。

截至2021年6月30日，公司共管理七十六只开放式基金：即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证100指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通成长30灵活配置混合型证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金(LOF)、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金(LOF)、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增悦债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金、融通通慧混合型证券投资基金、融通增祥

三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增强收益债券型证券投资基金、融通消费升级混合型证券投资基金、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增享纯债债券型证券投资基金、融通产业趋势股票型证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通产业趋势先锋股票型证券投资基金、融通通益混合型证券投资基金、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、融通产业趋势臻选股票型证券投资基金、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金（LOF）、融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金、融通价值趋势混合型证券投资基金、融通核心趋势混合型证券投资基金。其中，融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张婷	本基金的基金经理	2019/1/12	-	9	张婷女士，悉尼大学会计硕士，9 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2011 年 3 月至 2014 年 3 月就职于华泰柏瑞基金管理有限公司任研究员，2014 年 4 月至 2015 年 12 月就职于嘉实基金管理有限公司任投资经理，2016 年 1 月至 2016 年 6 月任职于易方达基金管理有限公司。2017 年 10 月加入融通基金管理有限公司，历任国际业务部研究员、融通丰利四分法证券投资基金基金经理，现任融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金经理。

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

回顾 2021 年上半年，伴随着新冠疫苗的逐步铺开和全球经济活动缓慢恢复正常，前期为了应对疫情而出台的各项宽松政策开始逐步退出，流动性预期的变化主导了整个市场大势和行业交易风格。港股市场开年以消费、科技等为代表的新经济成长股表现亮眼，但是随着 10 年期美债收益率的持续上行和货币政策收紧预期的明显升温，港股市场里面的传统经济为代表的价值板块和新经济为代表的成长板块之间的估值水平在上半年快速收敛，整体上价值跑赢成长。新经济板块的回落主要是由于受到反垄断等行业政策的影响，以及日渐白热化的行业竞争格局对互联网新经济的盈利展望和投资情绪的影响，使其估值水平已经大幅回落至去年年中水平。而对于传统经济，受益于全球复苏的原材料等价值风格板块在上半年明显反弹。在这一背景下，综合基本面和政策面等因素，投资策略上，我们在上半年注重均衡配置，在周期板块中里对全球服务业复苏敞口更大的石油石化、供需关系仍然紧张的航运等板块增加了行业上的配置，对成长板块中估值回落较大的优质龙头逆势加仓，同时积极配置了估值吸引股息丰厚的优质标的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1757 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.61%，业绩比较基准收益率为 3.62%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从经济趋势来看港股市场盈利仍然将保持较大幅度的同比正增长，但受疫情基数效应影响，下半年港股盈利同比增速会较上半年有所回落。但从全球来看，中国仍然是最早摆脱疫情影响，复苏最快的国家，下半年经济环比有望维持上行，所以港股市场盈利也因此有望环

比保持增长。海外货币环境有望在一定时期内仍然维持宽松。但在通胀压力之下，叠加美国就业情况在失业补贴计划到期后可能逐步改善，对宽松货币政策退出的讨论可能在后期对金融市场造成一定影响。全球的疫苗接种不平衡可能导致各国复苏的不平衡，目前发达市场的疫苗推广较为领先，进而后续在汇率和金融市场上可能对新兴市场构成一定压力。在下半年宏观环境仍然存在较大变数的情况下，整体市场的波动可能提升，结构性机会可能更为重要。

#### 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

从 2020 年 10 月 13 日至 2021 年 1 月 7 日，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）的管理人——融通基金管理有限公司在融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	32,328,738.24	15,202,497.34
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	88,288,953.51	27,916,744.71
其中：股票投资		88,288,953.51	27,916,744.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	339.75	297.26
应收股利		846.53	2,066.44
应收申购款		575,522.78	1,858,832.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		121,194,400.81	44,980,437.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	3,400,096.70
应付赎回款		4,565,225.02	2,499,943.38
应付管理人报酬		144,539.52	46,375.85
应付托管费		24,089.93	7,729.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	48,625.17	83,255.32
负债合计		4,782,479.64	6,037,400.57
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	99,015,665.42	35,641,823.61
未分配利润	6.4.7.10	17,396,255.75	3,301,213.60
所有者权益合计		116,411,921.17	38,943,037.21
负债和所有者权益总计		121,194,400.81	44,980,437.78

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1757 元，基金份额总额 99,015,665.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
一、收入		1,549,840.24	13,532,756.96

1. 利息收入		17,216.70	49,672.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,216.70	49,672.37
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		3,761,807.58	10,244,454.11
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,578,169.38	9,863,056.23
基金投资收益	6.4.7.13	-38,277.35	70,185.84
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,221,915.55	311,212.04
3. 公允价值变动收益	6.4.7.18	-2,627,331.20	2,861,047.85
4. 汇兑收益		-179,660.05	287,776.88
5. 其他收入	6.4.7.19	577,807.21	89,805.75
减：二、费用		1,455,792.69	727,920.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	808,651.81	373,883.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	134,775.29	62,313.98
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	469,967.96	256,587.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	252.67
7. 其他费用	6.4.7.21	42,397.63	34,882.50
三、利润总额		94,047.55	12,804,836.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润		94,047.55	12,804,836.45

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	35,641,823.61	3,301,213.60	38,943,037.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	94,047.55	94,047.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	63,373,841.81	14,000,994.60	77,374,836.41

其中：1. 基金申购款	153,973,054.42	29,627,536.56	183,600,590.98
2. 基金赎回款	-90,599,212.61	-15,626,541.96	-106,225,754.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	99,015,665.42	17,396,255.75	116,411,921.17
项目	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	72,491,256.79	-21,562,572.15	50,928,684.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	12,804,836.45	12,804,836.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-46,828,105.27	6,486,315.11	-40,341,790.16
其中：1. 基金申购款	15,654,458.86	-2,736,996.67	12,917,462.19
2. 基金赎回款	-62,482,564.13	9,223,311.78	-53,259,252.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	25,663,151.52	-2,271,420.59	23,391,730.93

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

颜锡廉

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金投资于境内境外市场。针对境内投资，本基金可投资于国内依法发行

上市的股票、债券等金融工具，具体包括：股票(包含中小板、创业板、其他依法上市的股票)，衍生工具(股指期货、权证、国债期货等)，债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单以及现金；法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。针对境外投资，本基金可投资于下列金融产品或工具：在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(以下无特别说明，均包括 Exchange Traded Fund, ETF)；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股(包括港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票)、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。本基金投资组合中：股票投资占基金资产的比例为 30% - 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：恒生指数(HangSengIndex)收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%。

#### 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值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[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]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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	32,328,738.24

定期存款	-
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	-
合计	32,328,738.24

注：于 2021 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 2,337,234.86 元，美元活期存款 3,802,675.46 元(折合人民币 24,565,663.74 元)，港币活期存款 6,520,814.88 元(折合人民币 5,425,839.64 元)。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	88,795,172.14	88,288,953.51	-506,218.63
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	88,795,172.14	88,288,953.51	-506,218.63

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	339.75
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	339.75

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

无。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,953.59
应付证券出借违约金	-
预提费用	39,671.58
合计	48,625.17

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,641,823.61	35,641,823.61
本期申购	153,973,054.42	153,973,054.42
本期赎回	-90,599,212.61	-90,599,212.61
本期末	99,015,665.42	99,015,665.42

#### 6.4.7.10 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	7,816,750.91	-4,515,537.31	3,301,213.60
本期利润	2,721,378.75	-2,627,331.20	94,047.55
本期基金份额交易产生的变动数	18,697,536.95	-4,696,542.35	14,000,994.60

其中：基金申购款	46,751,481.69	-17,123,945.13	29,627,536.56
基金赎回款	-28,053,944.74	12,427,402.78	-15,626,541.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,235,666.61	-11,839,410.86	17,396,255.75

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	17,027.81
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	188.89
合计	17,216.70

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,578,169.38
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	2,578,169.38

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	177,214,590.32
减：卖出股票成本总额	174,636,420.94
买卖股票差价收入	2,578,169.38

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	3,358,614.43

减：卖出/赎回基金成本总额	3,396,891.78
基金投资收益	-38,277.35

**6.4.7.14 债券投资收益**

无。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,218,462.47
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	3,453.08
合计	1,221,915.55

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,627,331.20
股票投资	-2,627,331.20
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	-2,627,331.20

**6.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	577,807.21
合计	577,807.21

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	469,967.96
银行间市场交易费用	-
合计	469,967.96

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	75.00
其他	2,651.05
合计	42,397.63

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	808,651.81	373,883.42
其中：支付销售机构的客户维护费	314,866.26	54,641.66

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

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

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	134,775.29	62,313.98

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

##### 6.4.10.3 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,337,314.32	17,511.54	3,277,180.54	6,893.57
布朗兄弟哈里曼银行	29,991,423.92	-483.73	4,656,696.64	42,778.80

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

## 6.4.10.6 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

无。

## 6.4.11 利润分配情况

无。

## 6.4.12 期末(2021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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金主要投资于境外股票、基金

和债券。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

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

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

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

监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，

确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行以及境外次托管人布朗兄弟哈里曼银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无债券投资（2020 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 2021 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 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 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。截止 2021 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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	32,328,738.24	-	-	-	32,328,738.24
交易性金融资产	-	-	-	88,288,953.51	88,288,953.51
应收利息	-	-	-	339.75	339.75
应收股利	-	-	-	846.53	846.53
应收申购款	-	-	-	575,522.78	575,522.78
资产总计	32,328,738.24	-	-	88,865,662.57	121,194,400.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,565,225.02	4,565,225.02
应付管理人报酬	-	-	-	144,539.52	144,539.52
应付托管费	-	-	-	24,089.93	24,089.93
其他负债	-	-	-	48,625.17	48,625.17
负债总计	-	-	-	4,782,479.64	4,782,479.64
利率敏感度缺口	32,328,738.24	-	-	84,083,182.93	116,411,921.17
上年度末 2020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	15,202,497.34	-	-	-	15,202,497.34
交易性金融资产	-	-	-	27,916,744.71	27,916,744.71
应收利息	-	-	-	297.26	297.26
应收股利	-	-	-	2,066.44	2,066.44
应收申购款	-	-	-	1,858,832.03	1,858,832.03
资产总计	15,202,497.34	-	-	29,777,940.44	44,980,437.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,499,943.38	2,499,943.38
应付管理人报酬	-	-	-	46,375.85	46,375.85
应付托管费	-	-	-	7,729.32	7,729.32
应付证券清算款	-	-	-	3,400,096.70	3,400,096.70
其他负债	-	-	-	83,255.32	83,255.32
负债总计	-	-	-	6,037,400.57	6,037,400.57
利率敏感度缺口	15,202,497.34	-	-	23,740,539.87	38,943,037.21

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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，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 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种折 合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	24,565,663.74	5,425,839.64	-	29,991,503.38
交易性金融资产	10,520,668.21	77,768,285.30	-	88,288,953.51
应收股利	846.53	-	-	846.53
资产合计	35,087,178.48	83,194,124.94	-	118,281,303.42
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	35,087,178.48	83,194,124.94	-	118,281,303.42
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种折 合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	6,143,074.92	7,953,030.69	-	14,096,105.61
交易性金融资产	13,709,255.53	14,207,489.18	-	27,916,744.71
应收股利	2,066.44	-	-	2,066.44
应收利息	-	0.97	-	0.97
资产合计	19,854,396.89	22,160,520.84	-	42,014,917.73
以外币计价的负债				
应付证券清算款	3,356,439.55	43,657.15	-	3,400,096.70
负债合计	3,356,439.55	43,657.15	-	3,400,096.70
资产负债表外汇风 险敞口净额	16,497,957.34	22,116,863.69	-	38,614,821.03

##### 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：人民币元)	
		本期末 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
		所有外币相对人民币升值 5%	5,914,065.17
所有外币相对人民币贬值 5%	-5,914,065.17	-1,930,741.05	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例不超过 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

#### 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	88,288,953.51	75.84	27,916,744.71	71.69
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	88,288,953.51	75.84	27,916,744.71	71.69

## 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: 人民币元)	
		本期末 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	3,585,532.37	1,017,111.28
	业绩比较基准下降 5%	-3,585,532.37	-1,017,111.28

## 6.4.14 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	88,288,953.51	72.85
	其中: 普通股	88,288,953.51	72.85
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	32,328,738.24	26.68
8	其他各项资产	576,709.06	0.48
9	合计	121,194,400.81	100.00

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位: 人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	77,768,285.30	66.80
美国	10,520,668.21	9.04

合计	88,288,953.51	75.84
----	---------------	-------

## 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(%)
能源	-	-
原材料	3,223,810.75	2.77
工业	14,127,944.56	12.14
非日常生活消费品	26,698,866.21	22.93
日常消费品	4,526,931.24	3.89
医疗保健	6,417,367.08	5.51
金融	3,119,201.65	2.68
信息技术	12,134,339.13	10.42
通信服务	3,452,333.20	2.97
公用事业	-	-
房地产	14,588,159.69	12.53
合计	88,288,953.51	75.84

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	TESLA INC	特斯拉	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	2,396	10,520,668.21	9.04
2	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	建滔积层板	1888 HK	香港联合交易所	中国香港	612,000	8,870,838.16	7.62
3	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	华润万象生活	1209 HK	香港联合交易所	中国香港	161,600	7,146,768.40	6.14
4	POP MART INTERNATIONAL GROUP	泡泡玛特	9992 HK	香港联合交易所	中国香港	105,200	6,740,180.83	5.79
5	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	东方海外国际	316 HK	香港联合交易所	中国香港	43,000	6,018,101.81	5.17
6	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	融创服务	1516 HK	香港联合交易所	中国香港	204,000	4,897,123.63	4.21
7	COSCO SHIPPING-H Equity	中远海控	1919 HK	香港联合交易所	中国香港	296,500	4,825,681.24	4.15
8	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	华润啤酒	291 HK	香港联合交易所	中国香港	78,000	4,526,931.24	3.89
9	ANGELALIGN	时代天	6699	香港联合交	中国香	10,600	3,533,311.23	3.04

	TECHNOLOGY INC	使	HK	易所	港			
10	BILIBILI INC-CLASS Z	哔哩哔哩	9626 HK	香港联合交 易所	中国香 港	4,340	3,452,333.20	2.97
11	MEITUAN DIANPING-B	美团点 评	3690 HK	香港联合交 易所	中国香 港	12,600	3,359,140.24	2.89
12	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	太平洋 航运	2343 HK	香港联合交 易所	中国香 港	1,261,000	3,284,161.51	2.82
13	KINGBOARD HOLDINGS LTD	建滔集 团	148 HK	香港联合交 易所	中国香 港	91,000	3,263,500.97	2.80
14	GANFENG LITHIU-H Equity	赣锋锂 业	1772 HK	香港联合交 易所	中国香 港	33,400	3,223,810.75	2.77
15	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交 易所	388 HK	香港联合交 易所	中国香 港	8,100	3,119,201.65	2.68
16	HOPE EDUCATION G Equity	希望教 育	1765 HK	香港联合交 易所	中国香 港	1,968,000	3,062,187.53	2.63
17	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	中汇集 团	382 HK	香港联合交 易所	中国香 港	466,000	3,016,689.40	2.59
18	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS Equity	四环医 药	460 HK	香港联合交 易所	中国香 港	1,044,000	2,884,055.85	2.48
19	KWG LIVING GROUP HOLDINGS LT	合景悠 活	3913 HK	香港联合交 易所	中国香 港	307,000	2,544,267.66	2.19

注：本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超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	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	14,049,978.82	36.08
2	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	1516 HK	10,893,958.33	27.97
3	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	10,249,493.92	26.32
4	KINGBOARD HOLDINGS LTD	148 HK	9,756,959.04	25.05
5	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	1888 HK	9,169,791.01	23.55
6	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	8,733,796.44	22.43
7	POP MART INTERNATIONAL GROUP	9992 HK	7,952,541.76	20.42
8	TESLA INC	TSLA US	7,596,779.92	19.51
9	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	9666 HK	7,328,397.95	18.82
10	APPLE INC	AAPL US	7,209,225.20	18.51
11	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	2343 HK	5,665,885.05	14.55
12	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	5,471,517.60	14.05

13	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	5,311,898.69	13.64
14	HOPE EDUCATION G Equity	1765 HK	5,236,428.76	13.45
15	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	RLX US	4,975,416.25	12.78
16	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	1877 HK	4,919,806.24	12.63
17	COSCO SHIPPING-H Equity	1919 HK	4,830,441.31	12.40
18	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	MNSO US	4,708,126.72	12.09
19	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	4,485,517.32	11.52
20	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	316 HK	3,795,128.46	9.75
21	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	3,727,860.88	9.57
22	BAIDU INC-SP ADR	BIDU US	3,681,078.77	9.45
23	ANGELALIGN TECHNOLOGY INC	6699 HK	3,679,035.21	9.45
24	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	3,626,895.28	9.31
25	LUMINAR TECHNOLOGIES INC	LAZR US	3,590,445.93	9.22
26	BILIBILI INC-CLASS Z	9626 HK	3,552,279.39	9.12
27	SHANDONG CHENMING PAPER-H	1812 HK	3,511,226.78	9.02
28	MEITUAN DIANPING-B	3690 HK	3,459,663.90	8.88
29	GANFENG LITHIU-H Equity	1772 HK	3,399,885.58	8.73
30	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2196 HK	3,385,729.25	8.69
31	BYD CO LTD-H	1211 HK	3,374,564.75	8.67
32	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	3,350,200.73	8.60
33	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	382 HK	3,266,622.04	8.39
34	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	3,266,001.03	8.39
35	NETEASE INC	9999 HK	3,205,791.00	8.23
36	NVIDIA CORP	NVDA US	3,134,938.25	8.05
37	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS Equity	460 HK	3,065,254.16	7.87
38	CREE INC	CREE US	3,020,919.66	7.76
39	CMGE TECHNOLOGY GROUP LTD	302 HK	2,855,374.28	7.33
40	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	FUTU US	2,662,511.76	6.84
41	LENOVO GROUP LTD	992 HK	2,632,391.32	6.76
42	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6078 HK	2,492,100.80	6.40
43	KWG LIVING GROUP HOLDINGS LT	3913 HK	2,310,469.92	5.93
44	TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	780 HK	2,300,475.38	5.91
45	ANGANG STEEL CO LTD-H	347 HK	2,158,178.39	5.54
46	CANAAN INC	CAN US	1,951,650.35	5.01
47	POWERLONG COMMERCIAL MANAGEM	9909 HK	1,748,928.14	4.49
48	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	2001 HK	1,631,049.80	4.19
49	ALBEMARLE CORP	ALB US	1,582,305.49	4.06
50	ZHOU HEI YA INTE Equity	1458 HK	1,325,920.98	3.40
51	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2600 HK	1,278,627.01	3.28
52	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	1,159,939.68	2.98
53	IGG INC	799 HK	1,096,688.44	2.82
54	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	1788 HK	1,059,263.91	2.72
55	GCL-POLY ENERGY Equity	3800 HK	1,046,033.16	2.69

56	WEIMOB INC	2013 HK	1,032,727.08	2.65
57	ACM RESEARCH INC-CLASS A	ACMR US	872,928.36	2.24

注：1、本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

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

### 7.5.2 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	APPLE INC	AAPL US	10,320,698.08	26.50
2	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	9,246,079.85	23.74
3	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	8,423,039.00	21.63
4	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	6,821,658.48	17.52
5	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	9666 HK	6,672,231.14	17.13
6	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	1516 HK	6,595,707.81	16.94
7	KINGBOARD HOLDINGS LTD	148 HK	6,154,798.66	15.80
8	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	MNSO US	6,093,039.78	15.65
9	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	291 HK	5,775,125.19	14.83
10	BYD CO LTD-H	1211 HK	5,693,976.13	14.62
11	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	5,677,844.74	14.58
12	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	1877 HK	4,853,489.49	12.46
13	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	4,704,798.58	12.08
14	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	4,511,802.87	11.59
15	BAIDU INC-SP ADR	BIDU US	4,291,635.15	11.02
16	NVIDIA CORP	NVDA US	3,687,013.51	9.47
17	JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1951 HK	3,657,286.06	9.39
18	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	2196 HK	3,397,837.97	8.73
19	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	3,351,926.16	8.61
20	SHANDONG CHENMING PAPER-H	1812 HK	3,349,442.74	8.60
21	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	3,326,347.55	8.54
22	LUMINAR TECHNOLOGIES INC	LAZR US	3,199,079.39	8.21
23	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	6969 HK	3,099,499.85	7.96
24	NETEASE INC	9999 HK	3,012,954.18	7.74
25	PACIFIC BASIN SHIPPING LTD	2343 HK	2,885,206.66	7.41
26	GCL-POLY ENERGY Equity	3800 HK	2,852,691.92	7.33
27	CMGE TECHNOLOGY GROUP LTD	302 HK	2,818,351.54	7.24
28	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	FUTU US	2,774,161.73	7.12
29	LENOVO GROUP LTD	992 HK	2,765,580.29	7.10
30	WEIMOB INC	2013 HK	2,637,967.95	6.77
31	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	6078 HK	2,523,890.12	6.48
32	CREE INC	CREE US	2,373,511.33	6.09
33	TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	780 HK	2,329,955.09	5.98
34	ALBEMARLE CORP	ALB US	2,253,335.48	5.79

35	NIO INC - ADR	NIO US	2,246,584.11	5.77
36	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	2001 HK	1,957,059.57	5.03
37	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	RLX US	1,876,689.76	4.82
38	ANGANG STEEL CO LTD-H	347 HK	1,758,152.35	4.51
39	POWERLONG COMMERCIAL MANAGEM	9909 HK	1,673,646.89	4.30
40	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	1,441,769.60	3.70
41	IGG INC	799 HK	1,379,801.27	3.54
42	ZHOU HEI YA INTE Equity	1458 HK	1,347,689.99	3.46
43	DADA NEXUS LTD-ADR	DADA US	1,309,677.40	3.36
44	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	1691 HK	1,300,322.38	3.34
45	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2600 HK	1,264,171.09	3.25
46	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	1,258,738.13	3.23
47	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	1,217,537.48	3.13
48	ACM RESEARCH INC-CLASS A	ACMR US	986,541.82	2.53
49	GUOTAI JUNAN INTERNATIONAL	1788 HK	960,642.05	2.47
50	TESLA INC	TSLA US	931,304.31	2.39
51	CANAAN INC	CAN US	909,145.51	2.33

注：1、本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

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

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	237,635,960.91
卖出收入（成交）总额	177,214,590.32

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

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

## 7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

## 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	846.53
4	应收利息	339.75
5	应收申购款	575,522.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	576,709.06

## 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## § 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 (%)
29,212	3,389.55	3,534,193.32	3.57	95,481,472.10	96.43

## 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	106,379.70	0.1074

## 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	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	0~10
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（2019 年 1 月 4 日）基金份额总额	19,839,642.93
本报告期期初基金份额总额	35,641,823.61
本报告期基金总申购份额	153,973,054.42
减：本报告期基金总赎回份额	90,599,212.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	99,015,665.42

## § 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，中国工商银行根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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

本报告期内，本基金的基金管理人、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	
CLSA	-	236,760,312.65	57.07%	71,028.12	55.54%	-
大和资本	-	97,644,449.61	23.54%	31,320.20	24.49%	-
CMS	-	66,653,910.69	16.07%	19,996.18	15.64%	-
CICC	-	6,991,745.49	1.69%	3,495.87	2.73%	-
Macquarie	-	6,800,132.79	1.64%	2,040.05	1.60%	-
CITI	-	-	-	-	-	-
EVERBRIGHT	-	-	-	-	-	-
GFSC	-	-	-	-	-	-
GTJA	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-
HTSC	-	-	-	-	-	-
ICBCI	-	-	-	-	-	-
JPMorgan	-	-	-	-	-	-
Morganstanley	-	-	-	-	-	-
海通国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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

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

2、券商选择的流程如下：

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

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

（3）评分记录归档并送国际业务部备案。

## 3、交易单元变更情况

本基金本报告期新增交易对手方 CMS。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-
大和资本	-	-	-	-	-	-	6,755,506.20	100.00%
CMS	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI	-	-	-	-	-	-	-	-
EVERBRIGHT	-	-	-	-	-	-	-	-
GFSC	-	-	-	-	-	-	-	-
GTJA	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
HTSC	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBCI	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan	-	-	-	-	-	-	-	-
Morganstanley	-	-	-	-	-	-	-	-
海通国际	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通关于旗下部分开放式基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并开通转换业务及参加其费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2021/3/10
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2021/3/16
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证券报、管理人网站	2021/3/29

4	融通关于旗下部分开放式基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构和新增开通基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、 管理人网站	2021/3/30
5	融通关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富开通定投及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、 管理人网站	2021/4/12
6	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、 管理人网站	2021/4/14
7	关于旗下部分开放式基金参与中国国际金融股份有限公司及中国中金财富证券有限公司费率优惠的公告	中国证券报、 管理人网站	2021/4/27
8	融通关于旗下部分开放式基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、 管理人网站	2021/5/17
9	关于东方财富证券销售的融通基金旗下部分开放式基金开通定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、 管理人网站	2021/6/8
10	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与上海基煜基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、 管理人网站	2021/6/24
11	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、 管理人网站	2021/6/30

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

（二）《融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金合同》

（三）《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)托管协议》

（四）《融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)招募说明书》及其更新

（五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

（六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 11.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日