

融通价值成长混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通价值成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2024 年 8 月 27 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
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	9
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
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通价值成长混合型证券投资基金	
基金简称	融通价值成长混合	
基金主代码	015553	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 18 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	322,980,072.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C
下属分级基金的交易代码	015553	015554
报告期末下属分级基金的份额总额	175,972,013.10 份	147,008,059.00 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	融通基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东
	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	95599
传真	(0755) 26935005	(010)68121816
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深 创投广场 41、42 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518054	100031
法定代表人	张威	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
----------------	-------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 41、42 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(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C
本期已实现收益	-10,372,828.87	-11,298,744.52
本期利润	-42,527,079.58	-33,860,263.46
加权平均基金份额本期利润	-0.2345	-0.2030
本期加权平均净值利润率	-23.97%	-20.91%
本期基金份额净值增长率	-21.42%	-21.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-24,331,382.26	-21,549,857.34
期末可供分配基金份额利润	-0.1383	-0.1466
期末基金资产净值	151,640,630.84	125,458,201.66
期末基金份额净值	0.8617	0.8534
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-13.83%	-14.66%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通价值成长混合 A

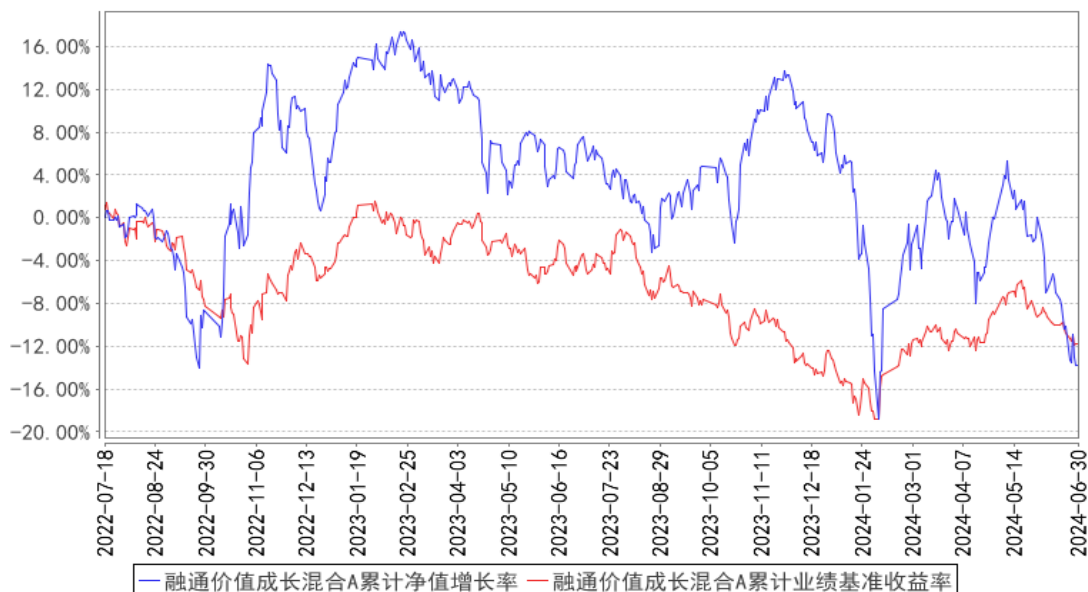
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-13.81%	1.48%	-2.76%	0.41%	-11.05%	1.07%
过去三个月	-13.57%	1.55%	-0.30%	0.64%	-13.27%	0.91%
过去六个月	-21.42%	1.89%	0.72%	0.81%	-22.14%	1.08%
过去一年	-19.38%	1.53%	-7.59%	0.75%	-11.79%	0.78%
自基金合同生效起至今	-13.83%	1.41%	-11.81%	0.78%	-2.02%	0.63%

融通价值成长混合 C

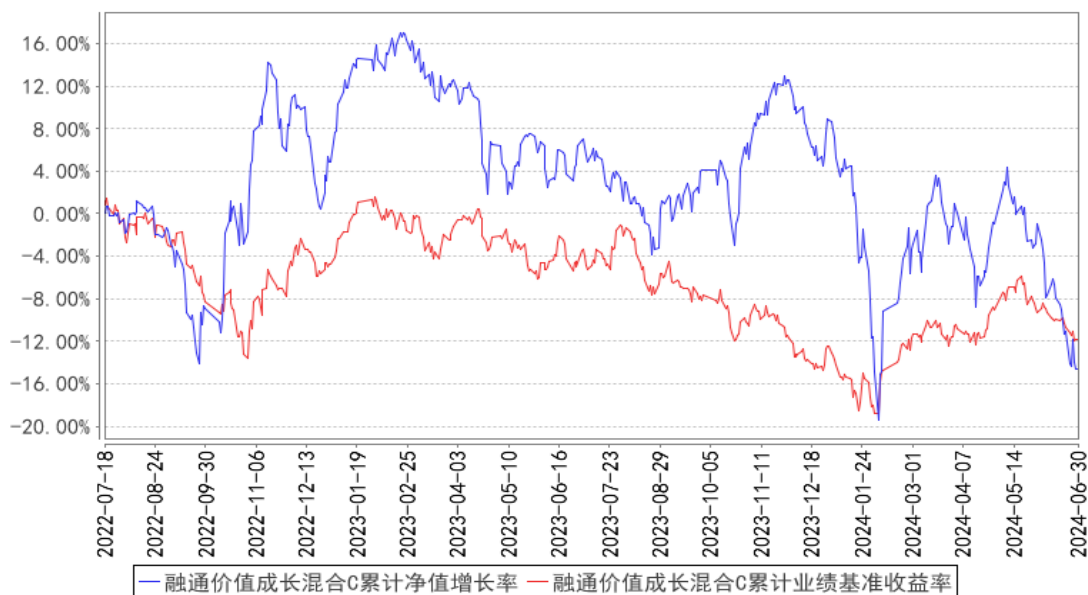
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-13.85%	1.48%	-2.76%	0.41%	-11.09%	1.07%
过去三个月	-13.67%	1.55%	-0.30%	0.64%	-13.37%	0.91%
过去六个月	-21.61%	1.89%	0.72%	0.81%	-22.33%	1.08%
过去一年	-19.77%	1.53%	-7.59%	0.75%	-12.18%	0.78%
自基金合同生效起至今	-14.66%	1.41%	-11.81%	0.78%	-2.85%	0.63%

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

融通价值成长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通价值成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：诚通

证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII 基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万民远	本基金的基金经理	2022 年 7 月 18 日	-	13 年	万民远先生，博士，13 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2011 年 1 月至 2012 年 4 月就职于中国银河证券任研究员，2012 年 5 月至 2014 年 4 月就职于国海证券任研究员，2014 年 4 月至 2015 年 6 月就职于融通基金管理有限公司任行业研究员，2015 年 6 月至 2016 年 6 月就职于深圳前海明远睿达投资管理有限公司投资经理。2016 年 7 月再次加入融通基金管理有限公司，曾任融通医疗保健行业混合型证券投资基金基金经理，现任融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通鑫新成长混合型证券投资基金基金经理、融通价值成长混合型证券投资基金基金经理、融通医疗保健行业混合型证券投资基金基金经理、融通远见价值一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、10 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

A 股市场制造出口及价值红利低波类资产表现较好，成长类资产整体较弱，体现了市场较强的防御心态。随着经济探底回升，市场整体也处在底部区域，我们对 A 股市场整体谨慎乐观。

本基金投资风格上坚持“守正出奇，逆向投资”，用绝对收益的理念做相对收益。即注重个股的估值安全边际，通过集中个股、分散细分领域，同时放弃估值泡沫的收益来控制组合的回撤风险。个股选择则坚持“逆向思维，人多的地方不去”原则，在企业经营阶段性低点布局，组合构建遵循产业趋势优先，成长与估值匹配。

本基金按照基金合同约定，精选赛道及成长性较好且估值相对较低的板块及个股进行重点配置，中线持股的心态从容守候，用时间换空间，并适时调整组合结构。我们依然坚持顺着中国经济转型升级和疫后修复的方向寻找投资机会，目前基金重点布局低位的医药、消费、新能源及科技等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通价值成长混合 A 基金份额净值为 0.8617 元，本报告期基金份额净值增长率为-21.42%，同期业绩比较基准收益率为 0.72%；

截至本报告期末融通价值成长混合 C 基金份额净值为 0.8534 元，本报告期基金份额净值增长率为-21.61%，同期业绩比较基准收益率为 0.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年经济压力仍大，三年大疫导致的居民及地方政府资产负债表均受到较大影响。国内需求不足导致内生动力不强，消费不及预期，地产持续下行对经济的拖累依旧，出口依然是上半年经济的亮点。稳地产、稳增长、促消费等稳经济稳信心的政策后续有望持续加码，加之灵活的财政政策及货币政策持续发力，经济有望实现弱复苏态势。中国经济正处在结构升级转型期，将从过去的高速增长进入高质量增长，我们对中国经济长期发展依然充满信心。

短期，A 股市场整体弱势震荡，市场整体表现为存量博弈，跷跷板效应较为明显。随着经济

探底回升，中国经济有望温和复苏，A 股市场整体也处在底部区域，且与全球主流权益资产相比，A 股整体估值性价比明显，当前定价也对市场悲观预期反应较为充分，我们对 A 股市场整体谨慎乐观，结构性机会将长期存在，居民资产向权益转移的趋势也依然不变。

我们依然坚持顺着中国经济转型升级和疫后修复的方向寻找投资机会。看好需求刚性的医药、疫后复苏相关的消费、以高端制造为代表具备全球竞争优势的出口相关产业和以 AI 等为代表的科技进步领域的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规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。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应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。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—融通基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	14,986,928.92	30,464,516.80
结算备付金		1,493,246.90	389,415.50
存出保证金		112,086.28	116,656.46
交易性金融资产	6.4.7.2	261,450,574.90	308,481,675.18
其中：股票投资		261,450,574.90	308,481,675.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		619,593.66	271,648.60
应收股利		71,200.00	-

应收申购款		62,582.82	283,115.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		278,796,213.48	340,007,028.51
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		776,666.42	13,629,551.03
应付赎回款		59,423.08	228,379.32
应付管理人报酬		321,831.41	306,457.66
应付托管费		53,638.55	51,076.31
应付销售服务费		66,668.31	42,194.63
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	6.4.7.9	419,153.21	484,419.15
负债合计		1,697,380.98	14,742,078.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	322,980,072.10	297,445,196.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-45,881,239.60	27,819,753.94
净资产合计		277,098,832.50	325,264,950.41
负债和净资产总计		278,796,213.48	340,007,028.51

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 322,980,072.10 份，其中融通价值成长混合 A 类基金份额 175,972,013.10 份，基金份额净值 0.8617 元；融通价值成长混合 C 类基金份额 147,008,059.00 份，基金份额净值 0.8534 元。

6.2 利润表

会计主体：融通价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
一、营业总收入		-73,545,592.97	8,985,152.06
1. 利息收入		84,235.87	113,311.12
其中：存款利息收入	6.4.7.13	84,235.87	113,311.12

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,981,704.45	8,686,478.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-22,252,315.26	7,047,704.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,270,610.81	1,638,773.80
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-54,715,769.65	-398,263.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	67,645.26	583,625.85
减：二、营业总支出		2,841,750.07	4,214,080.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,017,557.53	3,260,580.93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	336,259.51	543,430.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	400,177.98	314,798.66
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	87,755.05	95,270.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-76,387,343.04	4,771,071.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-76,387,343.04	4,771,071.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-76,387,343.04	4,771,071.83

6.3 净资产变动表

会计主体：融通价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	297,445,196.47	-	27,819,753.94	325,264,950.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	297,445,196.47	-	27,819,753.94	325,264,950.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	25,534,875.63	-	-73,700,993.54	-48,166,117.91
（一）、综合收益总额	-	-	-76,387,343.04	-76,387,343.04
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	25,534,875.63	-	2,686,349.50	28,221,225.13
其中：1. 基金申购款	190,405,133.63	-	-7,707,698.38	182,697,435.25
2. 基金赎回款	-164,870,258.00	-	10,394,047.88	-154,476,210.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	322,980,072.10	-	-45,881,239.60	277,098,832.50
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	466,690,857.83	-	23,751,498.00	490,442,355.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	466,690,857.83	-	23,751,498.00	490,442,355.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-239,713,012.17	-	-8,379,047.12	-248,092,059.29
（一）、综合收益总额	-	-	4,771,071.83	4,771,071.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-239,713,012.17	-	-13,150,118.95	-252,863,131.12
其中：1. 基金申购款	170,329,067.29	-	20,712,120.70	191,041,187.99
2. 基金赎回款	-410,042,079.46	-	-33,862,239.65	-443,904,319.11
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	226,977,845.66	-	15,372,450.88	242,350,296.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

商小虎

高翔

刘美丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

融通价值成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]626号《关于准予融通价值成长混合型证券投资基金注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 935,144,034.43 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0543 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融

通价值成长混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 7 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 935,362,715.48 份基金份额，其中认购资金利息折合 218,681.05 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：本基金股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 60%-95%(其中投资于港股通标的股票占本基金股票资产的比例为 0%-50%)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中证香港 100 指数收益率×20%+中债综合全价(总值)指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)

的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	14,986,928.92
等于：本金	14,983,295.84
加：应计利息	3,633.08
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

合计	14,986,928.92
----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	333,009,041.51	-	261,450,574.90	-71,558,466.61
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	333,009,041.51	-	261,450,574.90	-71,558,466.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	85.13
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	339,504.96
其中：交易所市场	339,504.96
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,563.12
合计	419,153.21

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通价值成长混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	183,068,419.15	183,068,419.15
本期申购	14,806,793.61	14,806,793.61
本期赎回（以“-”号填列）	-21,903,199.66	-21,903,199.66
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	175,972,013.10	175,972,013.10

融通价值成长混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	114,376,777.32	114,376,777.32
本期申购	175,598,340.02	175,598,340.02
本期赎回(以“-”号填列)	-142,967,058.34	-142,967,058.34
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	147,008,059.00	147,008,059.00

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

融通价值成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,548,504.79	4,132,541.33	17,681,046.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	13,548,504.79	4,132,541.33	17,681,046.12
本期利润	-10,372,828.87	-32,154,250.71	-42,527,079.58
本期基金份额交易产生的变动数	-344,936.34	859,587.54	514,651.20
其中：基金申购款	979,736.09	-1,298,881.62	-319,145.53
基金赎回款	-1,324,672.43	2,158,469.16	833,796.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,830,739.58	-27,162,121.84	-24,331,382.26

融通价值成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,591,473.69	2,547,234.13	10,138,707.82
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	7,591,473.69	2,547,234.13	10,138,707.82
本期利润	-11,298,744.52	-22,561,518.94	-33,860,263.46
本期基金份额交易产生的变动数	4,681,935.06	-2,510,236.76	2,171,698.30
其中：基金申购款	10,519,205.14	-17,907,757.99	-7,388,552.85
基金赎回款	-5,837,270.08	15,397,521.23	9,560,251.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	974,664.23	-22,524,521.57	-21,549,857.34

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	79,325.65	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	4,111.91	
其他	798.31	
合计	84,235.87	

注：此处其他列示的是基金交易保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-22,252,315.26	
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	-22,252,315.26	

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	260,564,174.65	
减：卖出股票成本总额	282,126,945.94	
减：交易费用	689,543.97	
买卖股票差价收入	-22,252,315.26	

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,270,610.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,270,610.81

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-54,715,769.65
股票投资	-54,715,769.65
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	-54,715,769.65

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	61,515.28
基金转换费收入	6,129.98
合计	67,645.26

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 基金的转换费用包括转换费和补差费，其中不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	8,191.93
合计	87,755.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
诚通证券股份有限公司（“诚通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,017,557.53	3,260,580.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	612,241.44	897,199.78
应支付基金管理人的净管理费	1,405,316.09	2,363,381.15

注：1. 于 2023 年 8 月 28 日前，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 \times 1.50% / 当年天数。

根据《融通基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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 \times 1.20% / 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	336,259.51	543,430.12

注：于 2023 年 8 月 28 日前，支付基金托管人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 \times 0.25% / 当年天数。

根据《融通基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 \times 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C	合计
融通基金	-	156,920.18	156,920.18
中国农业银行	-	10,735.35	10,735.35
诚通证券	-	9,360.31	9,360.31
合计	-	177,015.84	177,015.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C	合计
融通基金	-	173,596.28	173,596.28
中国农业银行	-	13,493.14	13,493.14
诚通证券	-	9,400.87	9,400.87
合计	-	196,490.29	196,490.29

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国农业银行	14,986,928.92	79,325.65	13,957,519.91	104,917.65

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024-03-19	1-6个月(含)	首发流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024-01-11	1-6个月(含)	首发流通受限	16.98	13.48	212	3,599.76	2,857.76	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	1-6个月(含)	首发流通受限	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月(含)	送股流通受限	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024-03-26	1-6个月(含)	首发流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024-05-28	1-6个月(含)	首发流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024-01-26	1-6个月(含)	首发流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	1-6个月(含)	首发流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	1-6个月(含)	首发流通受限	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-

301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	送股流通受限	-	91.24	42	-	3,832.08	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	1-6个月(含)	首发流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	1-6个月(含)	首发流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023-12-22	1-6个月(含)	首发流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	1-6个月(含)	首发流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	1-6个月(含)	首发流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024-03-06	1-6个月(含)	首发流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	1-6个月(含)	首发流通受限	126.89	188.01	335	42,508.15	62,983.35	-
301589	诺瓦星云	2024-05-30	1-6个月(含)	送股流通受限	-	188.01	268	-	50,386.68	-
301591	肯特股份	2024-02-20	1-6个月(含)	首发流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024-01-11	1-6个月(含)	首发流通受限	16.20	15.96	385	6,237.00	6,144.60	-
603082	北自科技	2024-01-23	1-6个月(含)	首发流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	首发流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1-6个月(含)	首发流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024-01-04	1-6个月(含)	首发流通受限	29.02	25.36	108	3,134.16	2,738.88	-
603325	博隆技术	2024-01-03	1-6个月(含)	首发流通受限	72.46	68.06	44	3,188.24	2,994.64	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	1-6个月(含)	首发流通受限	26.00	37.49	141	3,666.00	5,286.09	-
603344	星德胜	2024-03-13	1-6个月(含)	首发流通受限	19.18	22.66	179	3,433.22	4,056.14	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	首发流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	1-6个月(含)	首发流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024-01-17	1-6个月(含)	首发流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻	2024-06-19	1-6个月(含)	首发流通受限	23.35	25.13	144	3,362.40	3,618.72	-

	股份		月(含)	通受限						
688530	欧莱新材	2024-04-29	1-6个月(含)	首发流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024-02-01	1-6个月(含)	首发流通受限	22.66	15.89	437	9,902.42	6,943.93	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	1-6个月(含)	首发流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024-06-04	1-6个月(含)	首发流通受限	86.96	174.93	130	11,304.80	22,740.90	-
688695	中创股份	2024-03-06	1-6个月(含)	首发流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	1-6个月(含)	首发流通受限	15.69	18.79	540	8,472.60	10,146.60	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险高于债券型基金与货币市场基金，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。本基金如果投资港股通标的股票，可能会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

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

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2023 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 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2024 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,986,928.92	-	-	-	14,986,928.92
结算备付金	1,493,246.90	-	-	-	1,493,246.90
存出保证金	112,086.28	-	-	-	112,086.28
交易性金融资产	-	-	-	261,450,574.90	261,450,574.90
应收股利	-	-	-	71,200.00	71,200.00
应收申购款	-	-	-	62,582.82	62,582.82
应收清算款	-	-	-	619,593.66	619,593.66
资产总计	16,592,262.10	-	-	262,203,951.38	278,796,213.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	59,423.08	59,423.08
应付管理人报酬	-	-	-	321,831.41	321,831.41
应付托管费	-	-	-	53,638.55	53,638.55
应付清算款	-	-	-	776,666.42	776,666.42
应付销售服务费	-	-	-	66,668.31	66,668.31
其他负债	-	-	-	419,153.21	419,153.21
负债总计	-	-	-	1,697,380.98	1,697,380.98
利率敏感度缺口	16,592,262.10	-	-	-260,506,570.40	277,098,832.50
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,464,516.80	-	-	-	30,464,516.80
结算备付金	389,415.50	-	-	-	389,415.50
存出保证金	116,656.46	-	-	-	116,656.46
交易性金融资产	-	-	-	308,481,675.18	308,481,675.18
应收申购款	-	-	-	283,115.97	283,115.97
应收清算款	-	-	-	271,648.60	271,648.60
资产总计	30,970,588.76	-	-	309,036,439.75	340,007,028.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	228,379.32	228,379.32
应付管理人报酬	-	-	-	306,457.66	306,457.66
应付托管费	-	-	-	51,076.31	51,076.31
应付清算款	-	-	-	13,629,551.03	13,629,551.03
应付销售服务费	-	-	-	42,194.63	42,194.63
其他负债	-	-	-	484,419.15	484,419.15
负债总计	-	-	-	14,742,078.10	14,742,078.10

利率敏感度缺口	30,970,588.76	-	-294,294,361.65	325,264,950.41
---------	---------------	---	-----------------	----------------

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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2023 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	15,951,364.70	-	15,951,364.70
资产合计	-	15,951,364.70	-	15,951,364.70
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	-	15,951,364.70	-	15,951,364.70
项目	上年度末 2023 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				
交易性金融资产	-	7,772,032.71	-	7,772,032.71
资产合计	-	7,772,032.71	-	7,772,032.71
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	-	7,772,032.71	-	7,772,032.71

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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	797,568.24	388,601.64
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-797,568.24	-388,601.64

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)占基金资产的比例为 60% - 95%(其中投资于港股通标的股票的比例占本基金股票资产的 0%-50%)；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	261,450,574.90	94.35	308,481,675.18	94.84
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	261,450,574.90	94.35	308,481,675.18	94.84

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2024 年 6 月 30 日）	上年度末 （2023 年 12 月 31 日）
	1. 中证 800 指数收益率上升 5%	17,949,265.52	13,365,834.16
	2. 中证 800 指数收益率下降 5%	-17,949,265.52	-13,365,834.16

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	261,073,609.11	307,580,773.17
第二层次	45,611.11	-
第三层次	331,354.68	900,902.01
合计	261,450,574.90	308,481,675.18

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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	261,450,574.90	93.78
	其中：股票	261,450,574.90	93.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,480,175.82	5.91
8	其他各项资产	865,462.76	0.31
9	合计	278,796,213.48	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 15,951,364.70 元，占基金资产净值比例为 5.76%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	158,935,725.65	57.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	30,458,519.30	10.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,547,841.17	4.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,355,100.00	1.57
M	科学研究和技术服务业	19,326,855.48	6.97
N	水利、环境和公共设施管理业	6,144.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,869,024.00	7.53
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	245,499,210.20	88.60

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产	-	-
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	4,184,637.80	1.51
医疗保健	11,766,726.90	4.25
金融	-	-
科技	-	-
通讯	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	15,951,364.70	5.76

注：以上分类采用彭博行业分类标准（BICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688085	三友医疗	1,000,000	16,900,000.00	6.10
2	605266	健之佳	640,114	16,610,958.30	5.99
3	002727	一心堂	822,900	12,417,561.00	4.48
4	09926	康方生物	270,000	9,302,490.90	3.36
5	300244	迪安诊断	700,000	8,400,000.00	3.03
6	300705	九典制药	300,000	8,022,000.00	2.89
7	688426	康为世纪	400,000	7,440,000.00	2.68
8	688117	圣诺生物	263,561	6,467,786.94	2.33
9	600557	康缘药业	400,000	6,280,000.00	2.27
10	003029	吉大正元	350,800	6,240,732.00	2.25
11	301239	普瑞眼科	172,800	6,105,024.00	2.20
12	688091	上海谊众	260,000	5,873,400.00	2.12
13	600529	山东药玻	217,700	5,516,518.00	1.99
14	688298	东方生物	200,136	5,433,692.40	1.96
15	603538	美诺华	460,000	5,138,200.00	1.85
16	688670	金迪克	430,000	5,065,400.00	1.83
17	688373	盟科药业	1,135,711	4,940,342.85	1.78
18	688310	迈得医疗	364,000	4,782,960.00	1.73
19	301030	仕净科技	184,040	4,531,064.80	1.64
20	300662	科锐国际	270,000	4,355,100.00	1.57
21	301103	何氏眼科	200,000	4,292,000.00	1.55
22	688621	阳光诺和	98,552	4,208,170.40	1.52
23	688136	科兴制药	250,000	4,190,000.00	1.51
24	02367	巨子生物	100,000	4,184,637.80	1.51
25	300653	正海生物	200,000	4,070,000.00	1.47
26	000403	派林生物	150,000	3,999,000.00	1.44
27	688265	南模生物	181,387	3,780,105.08	1.36
28	688217	睿昂基因	187,312	3,697,538.88	1.33
29	301257	普蕊斯	120,000	3,390,000.00	1.22
30	301520	万邦医药	80,000	3,310,400.00	1.19
31	600587	新华医疗	200,000	3,148,000.00	1.14
32	603237	五芳斋	120,000	2,959,200.00	1.07
33	300740	水羊股份	200,000	2,936,000.00	1.06
34	603520	司太立	304,100	2,901,114.00	1.05
35	301363	美好医疗	100,000	2,900,000.00	1.05
36	300957	贝泰妮	60,000	2,899,200.00	1.05
37	603317	天味食品	250,000	2,852,500.00	1.03
38	000997	新大陆	200,000	2,782,000.00	1.00
39	002932	明德生物	159,945	2,688,675.45	0.97
40	300314	戴维医疗	258,800	2,675,992.00	0.97

41	301096	百诚医药	46,000	2,671,680.00	0.96
42	002661	克明食品	350,000	2,614,500.00	0.94
43	300773	拉卡拉	200,000	2,486,000.00	0.90
44	02162	康诺亚-B	80,000	2,464,236.00	0.89
45	688302	海创药业	100,000	2,356,000.00	0.85
46	688234	天岳先进	50,000	2,346,000.00	0.85
47	688317	之江生物	160,000	2,305,600.00	0.83
48	688382	益方生物	300,000	2,169,000.00	0.78
49	603165	荣晟环保	200,000	2,124,000.00	0.77
50	301267	华夏眼科	100,000	2,072,000.00	0.75
51	301220	亚香股份	80,000	2,041,600.00	0.74
52	688273	麦澜德	100,000	1,980,000.00	0.71
53	688372	伟测科技	50,000	1,966,500.00	0.71
54	301122	采纳股份	100,000	1,883,000.00	0.68
55	688443	智翔金泰	60,000	1,784,400.00	0.64
56	603811	诚意药业	280,000	1,750,000.00	0.63
57	688677	海泰新光	44,000	1,726,120.00	0.62
58	301097	天益医疗	40,000	1,505,600.00	0.54
59	300981	中红医疗	150,000	1,435,500.00	0.52
60	603233	大参林	100,000	1,430,000.00	0.52
61	688329	艾隆科技	80,000	1,188,800.00	0.43
62	300633	开立医疗	27,200	1,076,576.00	0.39
63	301589	诺瓦星云	603	113,370.03	0.04
64	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
65	688692	达梦数据	130	22,740.90	0.01
66	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
67	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.01
68	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.00
69	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
70	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
71	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
72	688709	成都华微	540	10,146.60	0.00
73	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
74	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
75	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
76	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
77	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
78	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
79	688584	上海合晶	437	6,943.93	0.00
80	601033	永兴股份	385	6,144.60	0.00
81	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
82	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
83	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00

84	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
85	603341	龙旗科技	141	5,286.09	0.00
86	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
87	603344	星德胜	179	4,056.14	0.00
88	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
89	603381	永臻股份	144	3,618.72	0.00
90	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
91	603325	博隆技术	44	2,994.64	0.00
92	001379	腾达科技	212	2,857.76	0.00
93	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
94	603312	西典新能	108	2,738.88	0.00
95	603004	鼎龙科技	158	2,678.10	0.00
96	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	003029	吉大正元	15,838,586.00	4.87
2	300244	迪安诊断	14,865,828.00	4.57
3	301017	漱玉平民	11,705,810.50	3.60
4	688085	三友医疗	11,700,039.21	3.60
5	301122	采纳股份	11,015,246.00	3.39
6	301239	普瑞眼科	10,748,208.00	3.30
7	002727	一心堂	10,423,945.00	3.20
8	605266	健之佳	9,472,375.75	2.91
9	603629	利通电子	9,429,588.00	2.90
10	09926	康方生物	8,960,217.98	2.75
11	688091	上海谊众	8,937,458.83	2.75
12	688670	金迪克	8,664,552.42	2.66
13	301267	华夏眼科	7,808,638.00	2.40
14	688050	爱博医疗	7,709,938.49	2.37
15	688310	迈得医疗	7,247,410.66	2.23
16	688298	东方生物	7,022,529.49	2.16
17	300314	戴维医疗	6,633,971.12	2.04
18	688373	盟科药业	6,606,811.96	2.03
19	688117	圣诺生物	6,347,176.82	1.95
20	603538	美诺华	6,100,618.90	1.88

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	301017	漱玉平民	13,339,915.25	4.10
2	300430	诚益通	10,962,096.00	3.37
3	301030	仕净科技	10,442,043.60	3.21
4	301122	采纳股份	8,961,700.60	2.76
5	688050	爱博医疗	8,594,012.22	2.64
6	603629	利通电子	8,033,722.00	2.47
7	003029	吉大正元	8,023,297.00	2.47
8	603589	口子窖	7,871,435.00	2.42
9	688319	欧林生物	6,859,970.53	2.11
10	688253	英诺特	6,422,647.49	1.97
11	000661	长春高新	5,551,235.58	1.71
12	300274	阳光电源	5,269,267.00	1.62
13	688399	硕世生物	4,862,418.71	1.49
14	603755	日辰股份	4,763,807.00	1.46
15	688358	祥生医疗	4,710,926.55	1.45
16	300118	东方日升	4,514,694.00	1.39
17	600522	中天科技	4,462,126.88	1.37
18	301220	亚香股份	4,397,258.00	1.35
19	300633	开立医疗	4,387,565.00	1.35
20	301267	华夏眼科	4,173,613.89	1.28

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	289,811,615.31
卖出股票收入（成交）总额	260,564,174.65

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

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

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	112,086.28
2	应收清算款	619,593.66
3	应收股利	71,200.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	62,582.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	865,462.76
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
融通价值成长混合 A	3,954	44,504.81	32,033,516.25	18.20	143,938,496.85	81.80
融通价值成长混合 C	14,046	10,466.19	110,207,583.32	74.97	36,800,475.68	25.03
合计	18,000	17,943.34	142,241,099.57	44.04	180,738,972.53	55.96

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通价值成长混合 A	3,251,074.28	1.84750
	融通价值成长混合 C	888,634.72	0.60448
	合计	4,139,709.00	1.28172

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通价值成长混合 A	融通价值成长混合 C
基金合同生效日（2022 年 7 月 18 日）基金份额总额	832,102,008.32	103,260,707.16
本报告期期初基金份额总额	183,068,419.15	114,376,777.32
本报告期基金总申购份额	14,806,793.61	175,598,340.02
减：本报告期基金总赎回份额	21,903,199.66	142,967,058.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	175,972,013.10	147,008,059.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

1、2024 年 1 月 27 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任张民为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2024 年 4 月 23 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，公司副总经理商小虎代任公司总经理，张帆不再担任公司总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人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(%)	
海通证券	2	221,615,003.82	40.38	207,412.25	40.86	-
广发证券	1	205,543,424.96	37.45	186,335.25	36.71	-
民生证券	1	68,554,352.06	12.49	64,157.67	12.64	-
国盛证券	1	41,801,000.65	7.62	39,121.97	7.71	-
财通证券	1	11,343,812.20	2.07	10,615.90	2.09	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下五个方面：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- 3) 券商利用其他专业研究咨询机构为本公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；
- 4) 严格禁止将席位开设与券商的基金销售挂钩；
- 5) 严格禁止向券商承诺基金在交易单元上的交易量。

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

- 1) 评价券商。投资研究相关部门对拟合作券商的研究质量与研究服务进行评价；

2) 拟定合作券商。投资研究相关部门根据券商选择标准, 拟定备选合作券商;

3) 上报批准。投资研究相关部门将备选合作券商上报至研究部, 由研究部将备选合作券商的情况上报公司批准;

4) 签署协议。在获得批准后, 研究部依据公司合同审批流程, 与确定的券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内新增财通证券交易单元 1 个, 终止租用东兴证券交易单元 1 个。

4、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求, 本公司已于法规规定的时间内, 完成调整相关交易费用。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 26 日
2	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 27 日
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金	中国证监会指	2024 年 2 月 20 日

	新增深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资及参加其申购费率优惠活动的公告	定报刊及网站	
4	关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 11 日
5	关于旗下部分开放式基金新增国信证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 22 日
6	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 23 日
7	关于旗下部分开放式基金新增江海证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 4 日
8	融通基金管理有限公司关于公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 15 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通价值成长混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通价值成长混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通价值成长混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通价值成长混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日