

融通核心价值混合型证券投资基金（QDII） 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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 3 月 30 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。本年度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 2020 年 3 月 22 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 审计报告	14
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§ 8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	41
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	41
8.4 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	41
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	42
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	46
8.7 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	46
8.8 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	46
8.9 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	46
8.10 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	46
8.11 投资组合报告附注	46
§ 9 基金份额持有人信息	47
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
9.3 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	47
§ 10 开放式基金份额变动	47
§ 11 重大事件揭示	47
11.1 基金份额持有人大会决议	47
11.2 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	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
11.4 基金投资策略的改变	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
11.8 其他重大事件	50
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	52
12.1 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	52
§ 13 备查文件目录	52
13.1 备查文件目录	52
13.2 存放地点	52
13.3 查阅方式	52

§ 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	35,641,823.61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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年 1 月 4 日（基金合同生效日）-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	17,264,085.87	-1,190,356.45
本期利润	19,780,155.89	-1,267,113.11
加权平均基金份额本期利润	0.3832	-0.0268
本期加权平均净值利润率	45.99%	-3.75%
本期基金份额净值增长率	55.53%	-0.92%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	3,301,213.60	-21,562,572.15
期末可供分配基金份额利润	0.0926	-0.2975
期末基金资产净值	38,943,037.21	50,928,684.64
期末基金份额净值	1.0926	0.7025
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	54.10%	-0.92%

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

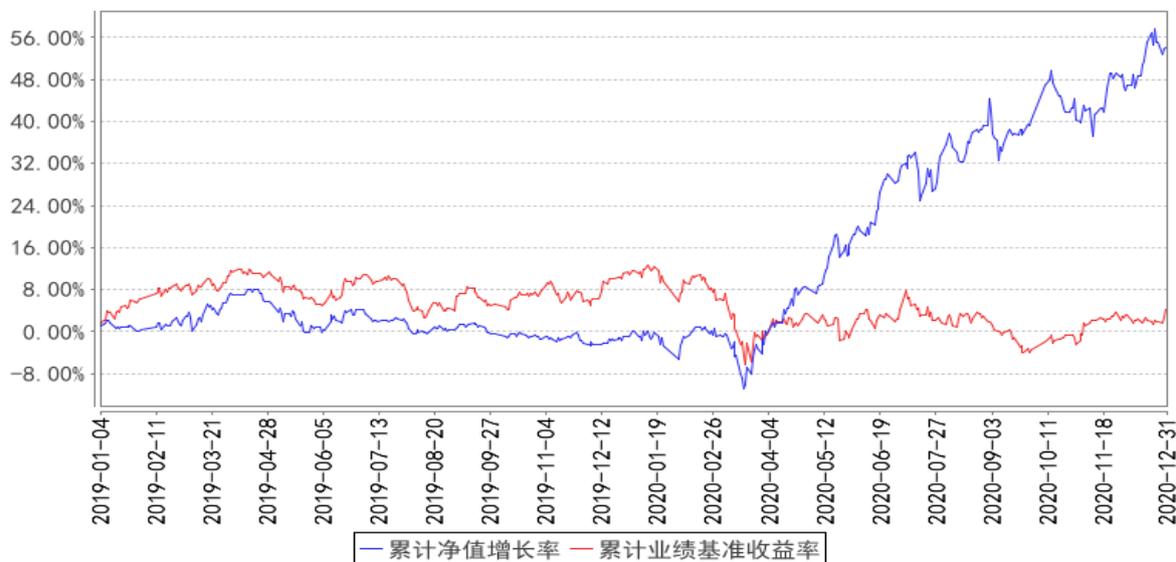
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	9.99%	1.28%	7.97%	0.69%	2.02%	0.59%
过去六个月	19.87%	1.29%	1.81%	0.78%	18.06%	0.51%
过去一年	55.53%	1.31%	-6.01%	1.05%	61.54%	0.26%
自基金合同生效起至今	54.10%	1.01%	4.23%	0.88%	49.87%	0.13%

注: 同期业绩比较基准以人民币计价。

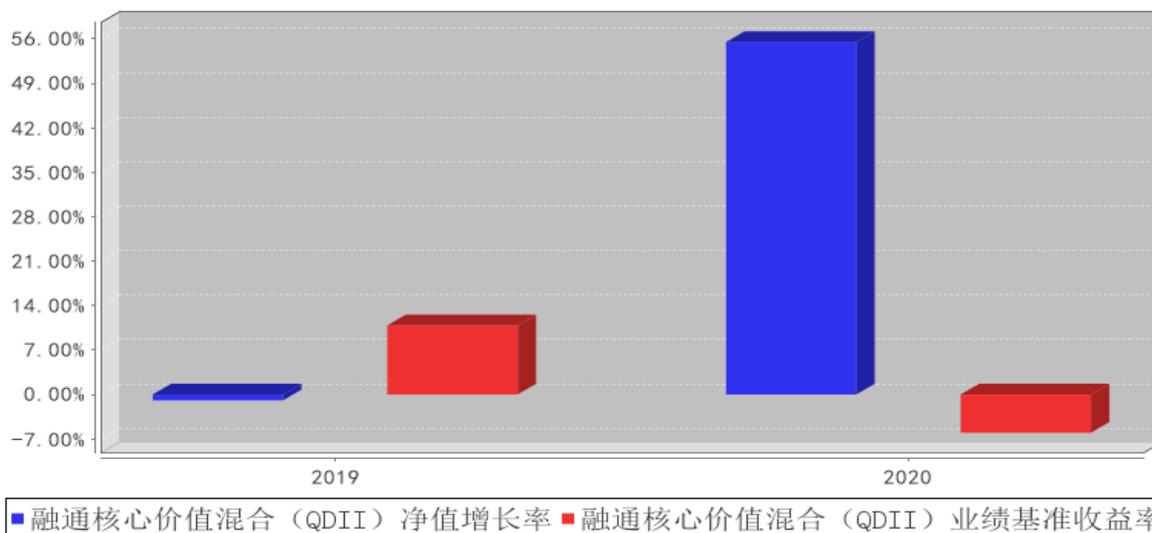
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通核心价值混合（QDII）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2019 年 1 月 4 日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020	-	-	-	-	-
2019	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 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（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至 2020 年 12 月 31 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、融通通捷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、融通通远三个月定期开放债券型证券投资基金、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、融通中证精准医疗主题指数证券投资基金（LOF）、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）。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	-	8	张婷女士，悉尼大学会计硕士，8 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。
何博	本基金的基金经理	2019/1/4	2020/8/14	8	何博女士，上海财经大学金融学硕士，8 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入融通基金管理有限公司，历任 QDII 研究员、国际业务部专户投资经理、融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金经理，现任融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、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各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制

度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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

2020 年是史无前例的一年：美股四次熔断、国际油价一夜暴“负”、股票市场千股跌停。新冠疫情的冲击引发了 2020 年 3 月初的市场暴跌。我们随后目睹了非同寻常的政策响应，这正是我们基金提高股票战略配置的最好时机。回顾 2020 年，在基金的投资策略和配置方面，虽然疫情围绕和困扰着经济，但我们上调了对股票乐观的看法，更加侧重优质资产，疫情加强了人们对可持续发展和电子商务主导地位的日益重视，我们在 2020 年也持续提高科技和医疗保健等优质资产的配置占比，受益于长期结构性利好因素的科技行业在全年里面都表现持续领先。同时，在 2020 年全年我们也非常注重持有周期性资产，我们认为财务稳健和现金流充裕的优质资产更具抗跌性，能够抵御经济活动全面重启前可能出现的颠簸。全年来看，我们超配增长和质量风格因子，这一观点贯穿了整个 2020 年。

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 1.0926 元；本报告期基金份额净值增长率为 55.53%，业绩比较基准收益率为-6.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前海外市场仍处于疫情、疫苗与财政刺激三者赛跑拉锯的影响之中。短期来看，市场里积极因素边际增多，欧美疫情仍在继续但疫苗进展顺利，经济陆续解封和新一轮财政政策的效果显现，将会推动全球主要经济体陆续回到复苏轨道。香港是一个全球化的市场，与全球经济的繁荣是密切相关。展望 2021 年，在全球疫苗落地大复苏的背景下，港股也会跟着大概率复苏。香港将

会在 2 月启动疫苗的接种，如果是疫情逐渐得到控制恢复通关，那么香港经济最差的时候就即将过去，港股明年盈利将有望得到较好的恢复性增长。拜登上台初期，中美关系有望迎来一段缓和期，新冷战或中美脱钩的风险下降，竞争合作的格局有望重新确立，不过不同于 2020 年，我们预计 2021 年市场风格切换将更加频繁，成长价值切换的主要催化剂包括疫情进展、无风险利率走势、盈利动能变化、中美关系及监管政策调整等。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算

部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2020 年 6 月 18 日至 2020 年 9 月 15 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。

从 2020 年 10 月 13 日至本报告期末，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。本报告期内，融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度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）2020 年年度报告中财务指标、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 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 22111 号

融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)全体基金份额持有人:

一、 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)(以下简称“融通核心价值混合基金(QDII)”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了融通核心价值混合基金(QDII)2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。

二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于融通核心价值混合基金(QDII),并履行了职业道德方面的其他责任。

三、 管理层和治理层对财务报表的责任

融通核心价值混合基金(QDII)的基金管理人融通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估融通核心价值混合基金(QDII)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算融通核心价值混合基金(QDII)、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督融通核心价值混合基金(QDII)的财务报告过程。

四、 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并

出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对融通核心价值混合基金（QDII）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致融通核心价值混合基金（QDII）不能持续经营。

（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天
注册会计师

会计师事务所(特殊普通合伙)
薛竞

中国上海市
注册会计师

2021 年 3 月 25 日
陈迺迤

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	15,202,497.34	24,692,220.07
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	27,916,744.71	23,294,136.35
其中：股票投资		27,916,744.71	23,294,136.35
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,538,659.89
应收利息	7.4.7.5	297.26	86.84
应收股利		2,066.44	-
应收申购款		1,858,832.03	38,525.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		44,980,437.78	52,563,628.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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		2,499,943.38	1,494,366.79
应付管理人报酬		46,375.85	65,899.24
应付托管费		7,729.32	10,983.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	83,255.32	63,694.67
负债合计		6,037,400.57	1,634,943.88
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	35,641,823.61	72,491,256.79
未分配利润	7.4.7.10	3,301,213.60	-21,562,572.15
所有者权益合计		38,943,037.21	50,928,684.64
负债和所有者权益总计		44,980,437.78	52,563,628.52

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0926 元，基金份额总额 35,641,823.61 份。

7.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 4 日（基 金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		21,132,434.63	-408,784.13
1. 利息收入		64,550.74	312,024.30
其中：存款利息收入	7.4.7.11	64,550.74	148,717.02
债券利息收入		-	150,743.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	12,563.41
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		18,635,237.29	-1,285,797.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	18,246,529.62	-953,288.60
基金投资收益	7.4.7.13	70,185.84	-314,094.13
债券投资收益	7.4.7.14	-	-177,619.49
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	318,521.83	159,204.94
3. 公允价值变动收益	7.4.7.18	2,516,070.02	-76,756.66
4. 汇兑收益		-675,839.30	344,341.96
5. 其他收入	7.4.7.19	592,415.88	297,403.55
减：二、费用		1,352,278.74	858,328.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	650,266.93	501,430.77
2. 托管费	7.4.10.2.2	108,377.83	83,571.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	452,903.99	213,003.37
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	942.77

7. 其他费用	7.4.7.21	140,477.32	59,380.26
三、利润总额		19,780,155.89	-1,267,113.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润		19,780,155.89	-1,267,113.11

7.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	19,780,155.89	19,780,155.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-36,849,433.18	5,083,629.86	-31,765,803.32
其中：1. 基金申购款	109,717,781.52	-4,251,428.60	105,466,352.92
2. 基金赎回款	-146,567,214.70	9,335,058.46	-137,232,156.24
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）	35,641,823.61	3,301,213.60	38,943,037.21
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 4 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 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）	19,839,642.93	-5,782,911.49	14,056,731.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,267,113.11	-1,267,113.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	52,651,613.86	-14,512,547.55	38,139,066.31
其中：1. 基金申购款	112,298,358.10	-29,283,894.15	83,014,463.95
2. 基金赎回款	-59,646,744.24	14,771,346.60	-44,875,397.64
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）	72,491,256.79	-21,562,572.15	50,928,684.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 4 日(基金转型生效日)至 2019 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资

产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	15,202,497.34	24,692,220.07
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	15,202,497.34	24,692,220.07

注：于 2020 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 1,106,391.73 元，美元活期存款 941,481.85 元（折合人民币 6,143,074.92 元），港币活期存款 9,449,444.76 元（折合人民币

7,953,030.69 元)。于 2019 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 437,879.88 元，美元活期存款 1,561,780.33 元(折合人民币 10,895,291.94 元)，港币活期存款 14,913,313.81 元(折合人民币 13,359,048.25 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,795,632.14	27,916,744.71	2,121,112.57
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	25,795,632.14	27,916,744.71	2,121,112.57
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,689,093.80	23,294,136.35	-394,957.45
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	23,689,093.80	23,294,136.35	-394,957.45

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	297.26	86.84
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	297.26	86.84

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

无。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,255.32	3,694.67
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	80,000.00	60,000.00
合计	83,255.32	63,694.67

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,491,256.79	72,491,256.79
本期申购	109,717,781.52	109,717,781.52
本期赎回	-146,567,214.70	-146,567,214.70
本期末	35,641,823.61	35,641,823.61

7.4.7.10 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	-15,119,183.04	-6,443,389.11	-21,562,572.15
本期利润	17,264,085.87	2,516,070.02	19,780,155.89
本期基金份额交易产生的变动数	5,671,848.08	-588,218.22	5,083,629.86
其中：基金申购款	9,170,157.28	-13,421,585.88	-4,251,428.60
基金赎回款	-3,498,309.20	12,833,367.66	9,335,058.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,816,750.91	-4,515,537.31	3,301,213.60

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月4日（基金合同生效日） 至2019年12月31日
活期存款利息收入	64,456.77	147,979.29
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	-	210.00
其他	93.97	527.73
合计	64,550.74	148,717.02

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月4日（基金合同生效日） 至2019年12月31日
卖出股票成交总额	194,728,071.04	56,384,447.55
减：卖出股票成本总额	176,481,541.42	57,337,736.15
买卖股票差价收入	18,246,529.62	-953,288.60

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月4日（基金合同生效日） 至2019年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	1,575,665.52	14,935,499.65
减：卖出/赎回基金成本总额	1,505,479.68	15,249,593.78
基金投资收益	70,185.84	-314,094.13

7.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 4 日（基金合同生效日） 至 2019 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	7,418,130.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	7,412,661.84
减：应收利息总额	-	183,088.40
买卖债券差价收入	-	-177,619.49

7.4.7.15 贵金属投资收益

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

无。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 4 日（基金合同生效日） 至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	318,521.83	157,261.81
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	1,943.13
合计	318,521.83	159,204.94

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 4 日（基金合同生效日） 至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,516,070.02	-76,756.66
股票投资	2,516,070.02	-394,957.45
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	318,200.79
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	2,516,070.02	-76,756.66

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月4日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	592,415.88	297,403.55
合计	592,415.88	297,403.55

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。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月4日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	452,903.99	213,003.37
银行间市场交易费用	-	-
合计	452,903.99	213,003.37

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月4日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
审计费用	30,000.00	59,671.23
信息披露费	50,000.00	-410.97
证券出借违约金	-	-
银行费用	130.00	120.00
公证费	25,000.00	-
律师费	35,000.00	-
其他	347.32	-
合计	140,477.32	59,380.26

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳市融通资本管理股份有限公司（“融通资本”）	本基金管理人能实施重大影响的联营企业

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、融通资本为融通基金持有 52.575% 股权比例的基金管理公司子公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至 2020年12月31日	2019年1月4日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	650,266.93	501,430.77
其中：支付销售机构的客户维护费	168,621.50	111,875.62

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至 2020年12月31日	2019年1月4日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	108,377.83	83,571.81

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月4日（基金合同生效日）至 2019年12月31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	1,106,432.04	21,149.11	437,883.02	18,305.52
布朗兄弟哈里曼银行	14,096,065.30	43,307.66	24,254,337.05	129,673.77

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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 2020 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 7.4.12。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 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
上年度末 2019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	24,692,220.07	-	-	-	24,692,220.07
交易性金融资产	-	-	-	23,294,136.35	23,294,136.35
应收利息	-	-	-	86.84	86.84
应收申购款	-	-	-	38,525.37	38,525.37
应收证券清算款	-	-	-	4,538,659.89	4,538,659.89

资产总计	24,692,220.07	-	-27,871,408.45	52,563,628.52
负债				
应付赎回款	-	-	1,494,366.79	1,494,366.79
应付管理人报酬	-	-	65,899.24	65,899.24
应付托管费	-	-	10,983.18	10,983.18
其他负债	-	-	63,694.67	63,694.67
负债总计	-	-	1,634,943.88	1,634,943.88
利率敏感度缺口	24,692,220.07	-	-26,236,464.57	50,928,684.64

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2019 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种折 合人民币元	合计
以外币计价的资产				

银行存款	10,895,291.94	13,359,048.25	-	24,254,340.19
交易性金融资产	-	23,294,136.35	-	23,294,136.35
应收证券清算款	-	4,538,659.89	-	4,538,659.89
资产合计	10,895,291.94	41,191,844.49	-	52,087,136.43
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	10,895,291.94	41,191,844.49	-	52,087,136.43

7.4.13.4.2.2 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	1,930,741.05	2,604,356.82
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,930,741.05	-2,604,356.82

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019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	27,916,744.71	71.69	23,294,136.35	45.74
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	27,916,744.71	71.69	23,294,136.35	45.74

7.4.13.4.3.2 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,017,111.28	1,029,643.76
	业绩比较基准下降5%	-1,017,111.28	-1,029,643.76

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为27,916,744.71元，无属于第二或第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次23,294,136.35元，无第二或第三层次)。

(ii) 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;对于定期开放的基金投资,本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次;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。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	27,916,744.71	62.06
	其中:普通股	22,597,489.95	50.24
	存托凭证	5,319,254.76	11.83
	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	15,202,497.34	33.80
8	其他各项资产	1,861,195.73	4.14

9	合计	44,980,437.78	100.00
---	----	---------------	--------

8.2 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	14,207,489.18	36.48
美国	13,709,255.53	35.20
合计	27,916,744.71	71.69

8.3 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	879,773.67	2.26
工业	-	-
非日常生活消费品	11,951,385.86	30.69
日常消费品	2,216,374.78	5.69
医疗保健	1,310,601.81	3.37
金融	-	-
信息技术	7,791,045.01	20.01
通信服务	1,439,116.02	3.70
公用事业	1,093,963.67	2.81
房地产	1,234,483.89	3.17
合计	27,916,744.71	71.69

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 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	美国证券交易所	美国	667	3,071,152.26	7.89
2	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	美国证券交易所	美国	3,465	2,999,958.82	7.70
3	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	比亚迪电子	285 HK	香港联合交易所	中国香港	73,500	2,511,537.92	6.45
4	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	思摩尔国际	6969 HK	香港联合交易所	中国香港	44,000	2,216,374.78	5.69
5	NIO INC - ADR	蔚来汽	NIO	美国证券	美国	5,986	1,903,689.43	4.89

		车	US	交易所				
6	DADA NEXUS LTD-ADR	达达集团	DADA US	美国证券交易所	美国	7,705	1,835,013.94	4.71
7	BYD CO LTD-H	比亚迪	1211 HK	香港联合交易所	中国香港	10,500	1,795,723.10	4.61
8	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	名创优品有限公司	MNSO US	美国证券交易所	美国	9,179	1,580,551.39	4.06
9	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	哔哩哔哩	BILI US	美国证券交易所	美国	2,573	1,439,116.02	3.70
10	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	阿里健康	241 HK	香港联合交易所	中国香港	68,000	1,310,601.81	3.37
11	GCL-POLY ENERGY Equity	保利协鑫能源	3800 HK	香港联合交易所	中国香港	1,250,000	1,294,021.50	3.32
12	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	华润万象生活	1209 HK	香港联合交易所	中国香港	40,800	1,234,483.89	3.17
13	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	135 HK	香港联合交易所	中国香港	194,000	1,093,963.67	2.81
14	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	JS 环球生活	1691 HK	香港联合交易所	中国香港	82,000	1,033,836.91	2.65
15	WEIMOB INC	微盟集团	2013 HK	香港联合交易所	中国香港	84,000	985,526.77	2.53
16	ALBEMARLE CORP	雅保公司	ALB US	美国证券交易所	美国	914	879,773.67	2.26
17	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃	3606 HK	香港联合交易所	中国香港	20,400	731,418.83	1.88

注：本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 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	TESLA INC	TSLA US	7,415,126.44	14.56
2	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	6,957,738.08	13.66
3	SINOTRUK HONG KONG LTD	3808 HK	6,022,526.11	11.83
4	ZTE-H Equity	763 HK	5,704,395.07	11.20
5	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	1877 HK	4,841,007.83	9.51

6	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	4,557,651.99	8.95
7	TIMES NEIGHBORHOOD HOLDINGS	9928 HK	4,485,064.42	8.81
8	HOPE EDUCATION G Equity	1765 HK	4,214,653.65	8.28
9	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	4,162,590.46	8.17
10	BYD CO LTD-H	1211 HK	4,131,480.56	8.11
11	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9922 HK	3,953,562.54	7.76
12	APPLE INC	AAPL US	3,922,893.28	7.70
13	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	3,885,986.58	7.63
14	POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	6049 HK	3,857,944.43	7.58
15	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	3,815,059.80	7.49
16	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	3,532,989.19	6.94
17	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,479,201.12	6.83
18	JD.COM INC - CL A	9618 HK	3,465,329.05	6.80
19	COFCO MEAT HOLDI Equity	1610 HK	3,146,686.84	6.18
20	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	884 HK	3,143,676.56	6.17
21	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	2,956,362.97	5.80
22	DADA NEXUS LTD-ADR	DADA US	2,948,968.63	5.79
23	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	2,792,946.26	5.48
24	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	DQ US	2,652,987.85	5.21
25	HAINAN MEILAN INTERNATIONA-H	357 HK	2,651,558.80	5.21
26	AGORA INC-ADR	API US	2,590,464.81	5.09
27	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	2,566,773.58	5.04
28	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	ZM US	2,552,006.36	5.01
29	YICHANG HEC CHANGJIANG PHARM	1558 HK	2,377,567.07	4.67
30	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	2,364,215.62	4.64
31	SEAZEN GROUP LTD	1030 HK	2,275,733.18	4.47
32	TELADOC HEALTH INC	TDOC US	1,929,661.44	3.79
33	SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	6969 HK	1,766,304.75	3.47
34	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	1233 HK	1,755,017.72	3.45
35	NIO INC - ADR	NIO US	1,663,098.31	3.27
36	WEIMOB INC	2013 HK	1,647,030.43	3.23
37	KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	1797 HK	1,643,949.97	3.23
38	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	1,581,183.61	3.10
39	SHANDONG GOLD -H Equity	1787 HK	1,579,061.12	3.10
40	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	1,570,991.27	3.08
41	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	2001 HK	1,555,459.49	3.05
42	AK MEDICAL HOLDI Equity	1789 HK	1,520,314.52	2.99
43	NIU TECHNOLOGIES-SPONS ADR	NIU US	1,512,030.56	2.97
44	TIANNENG POWER INTL LTD	819 HK	1,498,304.11	2.94
45	POWERLONG COMMERCIAL MANAGEM	9909 HK	1,447,030.06	2.84
46	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	2500 HK	1,445,586.61	2.84
47	KUNLUN ENERGY CO LTD	135 HK	1,444,425.89	2.84
48	COSCO SHIP ENG-H Equity	1138 HK	1,439,951.67	2.83

49	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	1,382,352.48	2.71
50	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	1070 HK	1,302,443.86	2.56
51	MINTH GROUP LTD	425 HK	1,259,814.70	2.47
52	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	MNSO US	1,241,626.44	2.44
53	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	3998 HK	1,170,757.15	2.30
54	JS GLOBAL LIFESTYLE CO LTD	1691 HK	1,147,973.17	2.25
55	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	909 HK	1,109,306.76	2.18
56	Texhong Textile Group Limited	2678 HK	1,079,975.03	2.12
57	GCL-POLY ENERGY Equity	3800 HK	1,063,903.14	2.09
58	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	1,042,292.84	2.05

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。

8.5.2 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	CANSINO BIOLOGICS INC-H	6185 HK	8,132,884.68	15.97
2	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	241 HK	7,983,801.99	15.68
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	7,939,934.39	15.59
4	WEICHAI POWER CO LTD-H	2338 HK	6,032,671.83	11.85
5	SINOTRUK HONG KONG LTD	3808 HK	5,998,557.97	11.78
6	SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-H	1877 HK	5,764,988.40	11.32
7	HEBEI CONSTRUCTION GROUP C-H	1727 HK	5,628,311.79	11.05
8	POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	6049 HK	5,567,916.81	10.93
9	ZTE-H Equity	763 HK	5,211,323.59	10.23
10	TESLA INC	TSLA US	5,134,420.78	10.08
11	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	5,103,950.63	10.02
12	INNOVENT BIOLOGICS INC	1801 HK	4,855,059.65	9.53
13	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	9922 HK	4,556,719.38	8.95
14	TIMES NEIGHBORHOOD HOLDINGS	9928 HK	4,539,752.19	8.91
15	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	DQ US	4,425,752.88	8.69
16	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	ZM US	4,350,241.41	8.54
17	HOPE EDUCATION G Equity	1765 HK	4,193,302.18	8.23
18	COFCO MEAT HOLDI Equity	1610 HK	3,753,855.78	7.37
19	JD.COM INC - CL A	9618 HK	3,547,026.01	6.96
20	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	3,484,179.49	6.84
21	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	884 HK	3,183,910.99	6.25
22	CHINA FEIHE LTD	6186 HK	3,140,552.96	6.17
23	TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	168 HK	2,871,713.27	5.64
24	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	2,662,806.22	5.23
25	BYD CO LTD-H	1211 HK	2,650,852.59	5.21
26	A-LIVING SERVICES CO LTD-H	3319 HK	2,442,688.60	4.80

27	AGORA INC-ADR	API US	2,295,486.82	4.51
28	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	2,241,316.23	4.40
29	SEAZEN GROUP LTD	1030 HK	2,161,829.62	4.24
30	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1918 HK	2,086,414.20	4.10
31	HAINAN MEILAN INTERNATIONAL-H	357 HK	2,077,743.13	4.08
32	YICHANG HEC CHANGJIANG PHARM	1558 HK	1,969,219.58	3.87
33	TELADOC HEALTH INC	TDOC US	1,916,327.70	3.76
34	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	2500 HK	1,810,618.45	3.56
35	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	6098 HK	1,807,706.21	3.55
36	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	1233 HK	1,803,705.16	3.54
37	AK MEDICAL HOLDI Equity	1789 HK	1,773,889.05	3.48
38	KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	1797 HK	1,735,871.44	3.41
39	COSCO SHIP ENG-H Equity	1138 HK	1,706,634.32	3.35
40	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	981 HK	1,703,945.05	3.35
41	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3323 HK	1,703,257.41	3.34
42	SHANDONG GOLD -H Equity	1787 HK	1,671,051.67	3.28
43	WUXI BIOLOGICS C Equity	2269 HK	1,591,060.72	3.12
44	CHINA NEW HIGHER EDUCATION G	2001 HK	1,546,513.12	3.04
45	TCL ELECTRONICS HOLDINGS LTD	1070 HK	1,498,065.32	2.94
46	POWERLONG COMMERCIAL MANAGEM	9909 HK	1,457,403.13	2.86
47	PING AN HEALTHCARE AND TECHN	1833 HK	1,327,038.02	2.61
48	NIU TECHNOLOGIES-SPONS ADR	NIU US	1,323,978.43	2.60
49	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	1,316,045.88	2.58
50	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	909 HK	1,305,964.73	2.56
51	MINTH GROUP LTD	425 HK	1,267,768.57	2.49
52	APPLE INC	AAPL US	1,246,203.68	2.45
53	TIANNENG POWER INTL LTD	819 HK	1,186,809.49	2.33
54	GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	2777 HK	1,185,439.02	2.33
55	BOSIDENG INTL HLDGS LTD	3998 HK	1,154,517.72	2.27
56	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	268 HK	1,094,843.47	2.15
57	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2333 HK	1,074,468.43	2.11
58	DADA NEXUS LTD-ADR	DADA US	1,033,635.11	2.03

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。

8.5.3 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	178,588,079.65
卖出收入（成交）总额	194,728,071.04

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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	2,066.44
4	应收利息	297.26
5	应收申购款	1,858,832.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,861,195.73

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
9,857	3,615.89	6,181.79	0.02	35,635,641.82	99.98

9.2 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	106,802.62	0.3000

9.3 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 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	72,491,256.79
本报告期基金总申购份额	109,717,781.52
减：本报告期基金总赎回份额	146,567,214.70
本报告期期末基金份额总额	35,641,823.61

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2020年9月17日至2020年10月11日融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于2020年10月12日表决通过了《关融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）修改基金合同有关事项的议案》。经与基金托管人协商一致，基金管理人据此修订了《融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金合同》、相应更新《融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）招募说明书》和《融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金产品资料概要》。修订于2020年10月13日生效。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大变动

2020 年 6 月 22 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》，经本基金管理人第六届董事会第四次定期会议审议通过，决定由邹曦先生担任公司副总经理职务。

11.2.2 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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 30,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
Macquarie	-	135,380,426.60	36.26%	41,539.27	36.52%	-
大和资本	-	122,593,547.53	32.84%	36,778.35	32.33%	-
HTSC	-	66,184,846.59	17.73%	19,855.46	17.46%	-
CLSA	-	46,651,861.01	12.50%	13,995.61	12.30%	-
CICC	-	2,505,468.96	0.67%	1,579.03	1.39%	-
CITI	-	-	-	-	-	-
EVERBRIGHT	-	-	-	-	-	-

GFSC	-	-	-	-	-	-
GTJA	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-
ICBCI	-	-	-	-	-	-
JPMorgan	-	-	-	-	-	-
Morganstanley	-	-	-	-	-	-
海通国际	-	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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

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

2、券商选择的流程如下：

- （1）针对券商等级评分，由国际业务部提出券商候选名单，风险管理部进行尽职调查，并提出评估报告；
- （2）组合经理和交易员根据券商研究服务品质、交易执行能力等因素，定期对往来下单券商进行综合评分；
- （3）评分记录归档并送国际业务部备案。

3、交易单元变更情况

本报告期新增 CLSA1 个交易券商。

11.7.2 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
Macquarie	-	-	-	-	-	-	3,083,250.77	100.00%
大和资本	-	-	-	-	-	-	-	-
HTSC	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-	-	-

CITI	-	-	-	-	-	-	-	-
EVERBRIGHT	-	-	-	-	-	-	-	-
GFSC	-	-	-	-	-	-	-	-
GTJA	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBCI	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan	-	-	-	-	-	-	-	-
Morganstanley	-	-	-	-	-	-	-	-
海通国际	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/1/4
2	融通基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2020/1/30
3	融通基金新增玄元保险为销售机构并开通定投、转换及参与其费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2020/2/20
4	融通关于旗下部分开放式基金参加万家财富申购费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/2/21
5	融通关于旗下部分开放式基金参加中国国际期货有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/3/13
6	关于旗下部分开放式基金参与华安证券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	2020/5/6
7	融通关于旗下部分开放式基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、管理人网站	2020/5/15
8	融通关于旗下部分开放式基金新增大连网金基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/6/4
9	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加恒泰证券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	2020/6/19
10	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2020/6/22
11	关于融通基金管理有限公司旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2020/6/29

		券日报、管理人网站	
12	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	2020/6/30
13	融通关于旗下部分开放式基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2020/7/2
14	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加海通证券股份有限公司申购及定期定额申购业务费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/7/24
15	融通关于旗下部分开放式基金参加渤海银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/7/31
16	融通关于旗下部分开放式基金参加北京展恒基金销售股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/8/5
17	融通核心价值混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、管理人网站	2020/8/14
18	关于融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）参加光大证券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	2020/9/3
19	融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）新增北京唐鼎耀华基金销售有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务及参加其费率优惠的公告	中国证券报、管理人网站	2020/9/3
20	关于以通讯方式召开融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金份额持有人大会的公告	中国证券报、管理人网站	2020/9/11
21	关于以通讯方式召开融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、管理人网站	2020/9/14
22	关于以通讯方式召开融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、管理人网站	2020/9/15
23	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增安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	中国证券报、管理人网站	2020/9/16
24	关于融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报、管理人网站	2020/10/13
25	融通关于旗下部分开放式基金参加和讯信息科技有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/11/17
26	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	2020/12/28
27	融通基金管理有限公司关于新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构并开通定期定额申购、转换业务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	2020/12/28
28	融通基金管理有限公司旗下部分证券投资基金关于2021年境外主要市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证券报、管理人网站	2020/12/28

29	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司“2021 倾心回馈”基金定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/12/28
30	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行 2021 年全年个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、管理人网站	2020/12/28

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200617-20200618	7,019,514.25	-	7,019,514.25	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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 3 月 30 日