

融通红利机会主题精选灵活配置混合型  
证券投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2023 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
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 .....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	46
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 .....	46
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 .....	46

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 .....	46
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 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	融通红利机会主题精选灵活配置混合	
基金主代码	005618	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 27 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	12,502,475.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通红利机会主题精选灵活配置混合 A	融通红利机会主题精选灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	005618	005619
报告期末下属分级基金的份额总额	9,959,896.93 份	2,542,578.37 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，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。
投资策略	本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例，并根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，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。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。
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。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。

### 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	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518053	100031

法定代表人	张威	谷澍
-------	----	----

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	融通红利机会主题精选灵活配置混合 A	融通红利机会主题精选灵活配置混合 C
本期已实现收益	-865,339.97	-237,946.11
本期利润	1,104,323.33	-55,387.46
加权平均基金份额本期利润	0.1337	-0.0274
本期加权平均净值利润率	6.62%	-1.38%
本期基金份额净值增长率	12.95%	12.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	8,359,792.31	1,997,966.90
期末可供分配基金份额利润	0.8393	0.7858
期末基金资产净值	20,602,141.93	5,115,268.41
期末基金份额净值	2.0685	2.0118
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	106.85%	101.16%

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

融通红利机会主题精选灵活配置混合 A

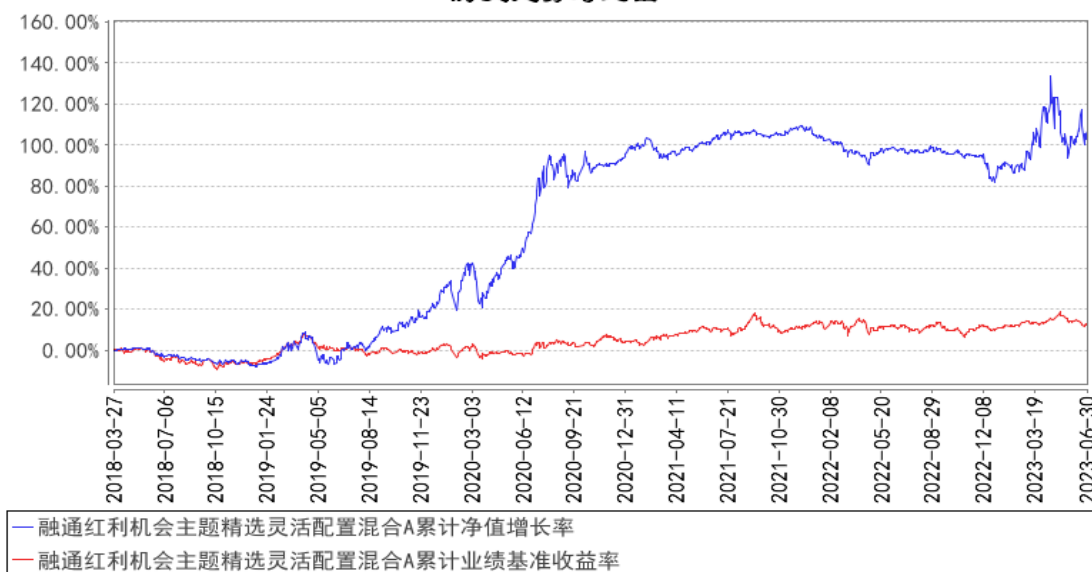
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.24%	1.86%	-1.27%	0.39%	2.51%	1.47%
过去三个月	1.93%	2.38%	-0.49%	0.42%	2.42%	1.96%
过去六个月	12.95%	1.86%	2.18%	0.38%	10.77%	1.48%
过去一年	4.48%	1.34%	0.60%	0.46%	3.88%	0.88%
过去三年	29.05%	0.99%	14.35%	0.56%	14.70%	0.43%
自基金合同生效起至今	106.85%	1.06%	12.52%	0.58%	94.33%	0.48%

融通红利机会主题精选灵活配置混合 C

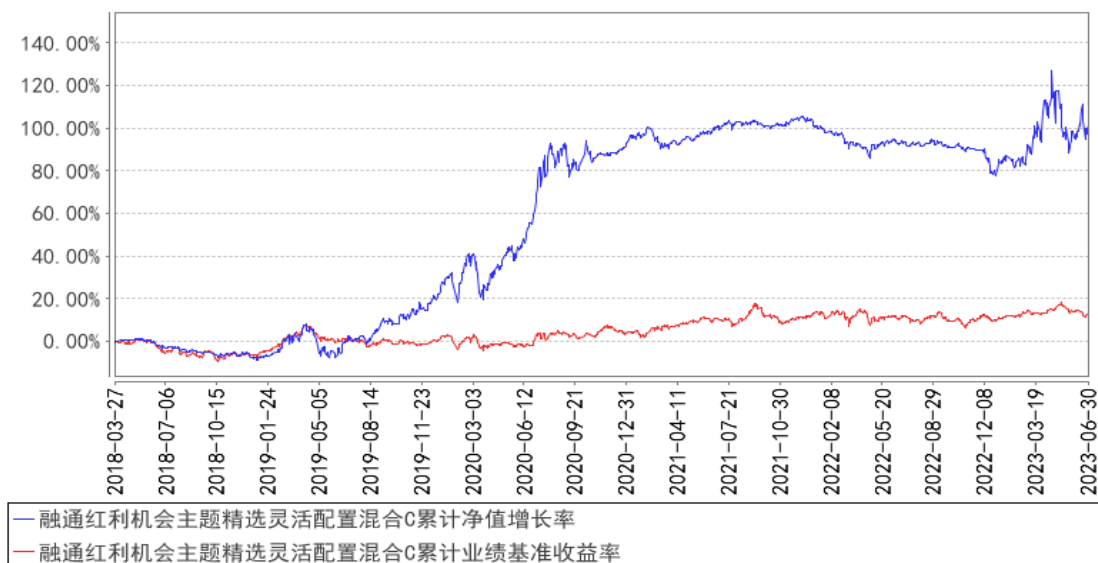
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.20%	1.86%	-1.27%	0.39%	2.47%	1.47%
过去三个月	1.80%	2.38%	-0.49%	0.42%	2.29%	1.96%
过去六个月	12.67%	1.86%	2.18%	0.38%	10.49%	1.48%
过去一年	3.96%	1.34%	0.60%	0.46%	3.36%	0.88%
过去三年	26.96%	0.99%	14.35%	0.56%	12.61%	0.43%
自基金合同生效起至今	101.16%	1.06%	12.52%	0.58%	88.64%	0.48%

### 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

融通红利机会主题精选灵活配置混合 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



融通红利机会主题精选灵活配置混合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、境内合格机构管理人资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境外机构投资者（RQFII）资格、合格境外机构投资者（QFII）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII基金等等。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何龙	本基金的基金经理、组合投资部副总监	2019/8/22	-	11	何龙先生，武汉大学金融学硕士，11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，历任金融行业研究员、策略研究员、融通新蓝筹证券投资基金基金经理、融通研究优选混合型证券投资基金基金经理、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通



					核心趋势混合型证券投资基金基金经理、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通益混合型证券投资基金基金经理，现任组合投资部副总监、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新蓝筹证券投资基金基金经理、融通价值趋势混合型证券投资基金基金经理、融通稳信增益 6 个月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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品从一月初开始专注于挖掘央国企改革带来的红利机会，因为我们判断资本市场将迎来新的投资周期。这一轮投资周期将以央国企改革为代表的制度红利叠加 AI 技术为主导的产业红利为主导，持续时间和空间都值得期待。从 2022 年 5 月 27 日国资委发布的《提高央企控股上市公司质量工作方案》开始，新一轮的央国企改革正式紧密的和资本市场紧密挂钩，资本市场价值发现功能将成为央国企高质量发展的重要评价，从此央国企管理层的利益诉求将和普通投资者完

全统一。以中国特色现代企业制度为基础的中国特色重估红利堪比当年股权分置改革带来制度红利，空间不可小觑。而以 AI 为主导的科技创新周期将对生产方式进行重构，大量的相关产业链的增长空间重新打开，也将面临重估，同时和数字经济相关的央国企也密切相关。结合两者，我们基于关键词“安全”重新构建了投资策略。

首先我们判断，基于“安全”，国央企改革重估路径有三条：基于科技安全的产业价值的重估；基于贸易安全的价值回归的重估；以及基于资本安全的价值发现的重估。由于西方世界为遏制中国崛起的科技封锁愈演愈烈，自主可控将是科技领域持续突破的关键，而 AIGC 将不可避免的引发国别层面和互联网大厂间的军备竞赛。相关产业链基于科技安全将以央国企为主导，特别是卡脖子环节和基础设施环节，因此，这个方面隐含的科技创新国家队的重估。而中东地缘政治格局的“突变”，也将带来“一带一路”相关产业链的重估。和国际工程相关的传统基建类行业或将迎来第二增长曲线，估值也面临重估。而价值发现主要基于央国企会加速利用资本市场的工具，将优质资产单独上市或者注入上市平台，形成公允定价。同时，因为市场化考核机制的不断明确，央国企经营行为也将面临调整，市场化机制不断激活，相关公司的市场价值也将不断被发现，形成重估。

其次，我们判断行情的节奏，以确定我们的组合构建思路。首先，今年的大环境是经济偏弱，却无崩溃式风险。衰退式宽松的大背景将给市场的主题投资提供沃土。因此，我们从三年的维度看，今年偏重主题，以 AIGC 和“一带一路”为主线的主题投资机会的弹性和波动都较大，而明年和后年，将遍地开花，机制优化开始传导到各个央国企的经营成果上，个股的挖掘将尤为重要。基于这个判断，我们以优化收益率曲线，以较小的波动风险获得较大的收益弹性为目的，进行组合。考虑到重估路径一和路径二分别代表 AIGC 和“一带一路”，且相互间的贝塔属性是不相关的，基于此，我们本季度开始将这两类方向的标的为主要配置方向，利用内部结构对冲原理，平抑各自较大的波动，在获得各自方向贝塔性机会的同时，也使得产品持有体验进一步优化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通红利机会主题精选 A 基金份额净值为 2.0685 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.95%，同期业绩比较基准收益率为 2.18%；

截至本报告期末融通红利机会主题精选 C 基金份额净值为 2.0118 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.67%，同期业绩比较基准收益率为 2.18%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断，下半年依然呈现弱复苏，宽流动性的宏观组合态势，政策定力稳定了我们长期的抗风险能力预期，股债性价比到了比较极值的区间，股票市场整体估值有望上修。传统行业的库

存周期和新兴经济的产业趋势有望在下半年形成共振，股票市场已经进入了三年维度的较好配置区间。在宏观呈现弱复苏阶段，我们认为股票市场依然以结构性特征为主导，顺周期板块，新能源，TMT 等方向依然会反复胶着。而一旦宏观从弱复苏上修至强复苏，或者新兴产业，如人工智能等方向出现了新的变化，比如需求或者订单的超预期落地，那么市场有望从结构性特征切换至趋势性特征，市场的赚钱效应也会有明显改善。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性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。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和

国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—融通基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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：融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,085,960.81	1,629,699.52
结算备付金		393,909.67	-
存出保证金		32,616.76	688.87
交易性金融资产	6.4.7.2	23,580,887.60	12,056,973.30
其中：股票投资		23,580,887.60	12,056,973.30
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		-	836,906.20
应收股利		-	-
应收申购款		13,572.12	3,747.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		27,106,946.96	14,528,015.81
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,130,087.20	-
应付赎回款		20,163.56	4,384.29
应付管理人报酬		33,052.01	19,015.22
应付托管费		5,508.70	3,169.18
应付销售服务费		2,358.59	801.56
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	198,366.56	197,164.40
负债合计		1,389,536.62	224,534.65
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	12,502,475.30	7,836,004.85
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	13,214,935.04	6,467,476.31
净资产合计		25,717,410.34	14,303,481.16
负债和净资产总计		27,106,946.96	14,528,015.81

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 12,502,475.30 份，其中融通红利机会主题精选灵活配置混合 A 类基金份额 9,959,896.93 份，基金份额净值 2.0685 元；融通红利机会主题精选灵活配置混合 C 类基金份额 2,542,578.37 份，基金份额净值 2.0118 元。

## 6.2 利润表

会计主体：融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		1,269,033.26	-19,847,228.80
1. 利息收入		15,082.95	52,576.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,064.21	35,815.48
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		1,018.74	16,761.50
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-934,973.15	3,540,568.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,100,519.46	-321,573.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	3,857,231.20
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	165,546.31	4,910.91
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	2,152,221.95	-23,599,289.65
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	36,701.51	158,915.29
<b>减：二、营业总支出</b>		220,097.39	1,954,445.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	154,283.55	1,334,565.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,713.93	222,427.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,923.20	262,701.50
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	15,090.26
其中：卖出回购金融资产支出		-	15,090.26
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.26
8. 其他费用	6.4.7.23	30,176.71	119,660.23
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）</b>		1,048,935.87	-21,801,674.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,048,935.87	-21,801,674.23
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,048,935.87	-21,801,674.23

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	7,836,004.85	-	6,467,476.31	14,303,481.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	7,836,004.85	-	6,467,476.31	14,303,481.16
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	4,666,470.45	-	6,747,458.73	11,413,929.18
(一)、综合收益总额	-	-	1,048,935.87	1,048,935.87
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数 (净值减少以“-”号 填列)	4,666,470.45	-	5,698,522.86	10,364,993.31
其中：1. 基金申购款	11,823,680.67	-	13,195,312.56	25,018,993.23
2. 基金赎回款	-7,157,210.22	-	-7,496,789.70	-14,653,999.92
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动(净 值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	12,502,475.30	-	13,214,935.04	25,717,410.34
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	215,474,888.27	-	227,856,062.71	443,330,950.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	215,474,888.27	-	227,856,062.71	443,330,950.98
三、本期增减变动额	-206,413,639.32	-	-219,028,598.85	-425,442,238.17

(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-21,801,674.23	-21,801,674.23
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-206,413,639.32	-	-197,226,924.62	-403,640,563.94
其中: 1. 基金申购款	4,315,430.78	-	4,347,670.18	8,663,100.96
2. 基金赎回款	-210,729,070.10	-	-201,574,594.80	-412,303,664.90
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	9,061,248.95	-	8,827,463.86	17,888,712.81

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张帆

高翔

刘美丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

融通红利机会主题精选灵活配置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[2018]19号《关于准予融通红利机会主题精选灵活配置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《融通红利机会主题精选灵活配置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633,243,898.70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(2018)第0218号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年3月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为633,411,312.51份基金份额,其中认购资金利息折合167,413.81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《融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费等收



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；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用的基金份额类别，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《融通红利机会主题精选灵活配置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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、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（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换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、权证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）。本基金投资组合中，股票投资（含存托凭证）占基金资产的比例为 0%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例占本基金股票资产的 0%-50%），投资于红利机会主题相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指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%。本基金业绩比较基准为：中证红利指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。

#### 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》、《融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,085,960.81
等于：本金	3,085,319.00
加：应计利息	641.81
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	3,085,960.81

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		22,132,884.11	-	23,580,887.60	1,448,003.49
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		22,132,884.11	-	23,580,887.60	1,448,003.49

#### 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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	180,620.18
其中：交易所市场	180,620.18
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	17,730.98
合计	198,366.56

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通红利机会主题精选灵活配置混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,814,646.02	6,814,646.02
本期申购	6,172,288.39	6,172,288.39
本期赎回（以“-”号填列）	-3,027,037.48	-3,027,037.48
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	9,959,896.93	9,959,896.93

融通红利机会主题精选灵活配置混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,021,358.83	1,021,358.83
本期申购	5,651,392.28	5,651,392.28
本期赎回（以“-”号填列）	-4,130,172.74	-4,130,172.74
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	2,542,578.37	2,542,578.37

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

##### 融通红利机会主题精选灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,055,381.53	-390,155.44	5,665,226.09
本期利润	-865,339.97	1,969,663.30	1,104,323.33
本期基金份额交易产生的变动数	3,169,750.75	702,944.83	3,872,695.58
其中：基金申购款	5,891,524.47	1,354,153.75	7,245,678.22
基金赎回款	-2,721,773.72	-651,208.92	-3,372,982.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,359,792.31	2,282,452.69	10,642,245.00

##### 融通红利机会主题精选灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	856,378.43	-54,128.21	802,250.22
本期利润	-237,946.11	182,558.65	-55,387.46
本期基金份额交易产生的变动数	1,379,534.58	446,292.70	1,825,827.28
其中：基金申购款	4,797,975.60	1,151,658.74	5,949,634.34
基金赎回款	-3,418,441.02	-705,366.04	-4,123,807.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,997,966.90	574,723.14	2,572,690.04

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,543.94
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	2,407.63
其他	112.64

合计	14,064.21
----	-----------

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,100,519.46
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	-1,100,519.46

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	146,485,414.50
减：卖出股票成本总额	147,130,673.37
减：交易费用	455,260.59
买卖股票差价收入	-1,100,519.46

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	165,546.31
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	165,546.31

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,152,221.95
股票投资	2,152,221.95
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-



贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,152,221.95

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	31,659.38
基金转换费收入	5,042.13
合计	36,701.51

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

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

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	8,430.98
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	3,145.73
账户维护费	18,600.00
合计	30,176.71

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
诚通证券	1,798,358.00	0.59	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
诚通证券	1,656.82	0.60	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
诚通证券	-	-	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	154,283.55	1,334,565.57
其中：支付销售机构的客户维护费	62,920.54	173,811.04

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

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

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,713.93	222,427.61

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通红利机会主题精选灵活配置 混合 A	融通红利机会主题精选灵活配置 混合 C	合计
融通基金	-	438.18	438.18
诚通证券	-	534.81	534.81
合计	-	972.99	972.99
获得销售服务费	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		

的各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通红利机会主题精选灵活配置 混合 A	融通红利机会主题精选灵活配置 混合 C	合计
融通基金	-	196,043.54	196,043.54
诚通证券	-	531.52	531.52
合计	-	196,575.06	196,575.06

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

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,085,960.81	11,543.94	5,763,800.05	34,162.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

履行相应风险管理和监督职责。

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

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计



资产					
银行存款	3,085,960.81	-	-	-	3,085,960.81
结算备付金	393,909.67	-	-	-	393,909.67
存出保证金	32,616.76	-	-	-	32,616.76
交易性金融资产	-	-	-	-23,580,887.60	23,580,887.60
应收申购款	-	-	-	13,572.12	13,572.12
资产总计	3,512,487.24	-	-	-23,594,459.72	27,106,946.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,163.56	20,163.56
应付管理人报酬	-	-	-	33,052.01	33,052.01
应付托管费	-	-	-	5,508.70	5,508.70
应付清算款	-	-	-	1,130,087.20	1,130,087.20
应付销售服务费	-	-	-	2,358.59	2,358.59
其他负债	-	-	-	198,366.56	198,366.56
负债总计	-	-	-	1,389,536.62	1,389,536.62
利率敏感度缺口	3,512,487.24	-	-	-22,204,923.10	25,717,410.34
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,629,699.52	-	-	-	1,629,699.52
存出保证金	688.87	-	-	-	688.87
交易性金融资产	-	-	-	-12,056,973.30	12,056,973.30
应收申购款	-	-	-	3,747.92	3,747.92
应收清算款	-	-	-	836,906.20	836,906.20
资产总计	1,630,388.39	-	-	-12,897,627.42	14,528,015.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,384.29	4,384.29
应付管理人报酬	-	-	-	19,015.22	19,015.22
应付托管费	-	-	-	3,169.18	3,169.18
应付销售服务费	-	-	-	801.56	801.56
其他负债	-	-	-	197,164.40	197,164.40
负债总计	-	-	-	224,534.65	224,534.65
利率敏感度缺口	1,630,388.39	-	-	-12,673,092.77	14,303,481.16

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	778,003.60	-	778,003.60
资产合计	-	778,003.60	-	778,003.60
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	-	778,003.60	-	778,003.60
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末 （2023年6月30日）	上年度末 （2022年12月31日）	
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	38,900.18	-
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-38,900.18	-

#### 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（含存托凭证）投资占基金资产的比例为 0% - 95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例占本基金股票资产的 0%-50%）。本基金投资于红利机会主题相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	23,580,887.60	91.69	12,056,973.30	84.29
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	23,580,887.60	91.69	12,056,973.30	84.29

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证红利指数以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2023年6月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
分析	1. 中证红利指数上升 5%	1,558,818.65	151,744.53
	2. 中证红利指数下降 5%	-1,558,818.65	-151,744.53

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	23,580,887.60	12,056,973.30
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	23,580,887.60	12,056,973.30

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	23,580,887.60	86.99
	其中：股票	23,580,887.60	86.99

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	3,479,870.48	12.84
8	其他各项资产	46,188.88	0.17
9	合计	27,106,946.96	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,057,385.00	8.00
C	制造业	5,289,794.00	20.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,761,526.00	37.96
F	批发和零售业	379,208.00	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	1,657,821.00	6.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	672,804.00	2.62
J	金融业	2,495,466.00	9.70
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	488,880.00	1.90
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,802,884.00	88.67

### 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	778,003.60	3.03
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
科技	-	-
通讯	-	-
公用事业	-	-
政府	-	-
合计	778,003.60	3.03

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	601186	中国铁建	118,000	1,162,300.00	4.52
1	01186	中国铁建	146,500	778,003.60	3.03
2	601800	中国交建	167,800	1,830,698.00	7.12
3	300308	中际旭创	11,200	1,651,440.00	6.42
4	300394	天孚通信	14,400	1,538,352.00	5.98
5	002051	中工国际	115,200	1,374,336.00	5.34
6	600970	中材国际	105,800	1,348,950.00	5.25
7	601390	中国中铁	166,500	1,262,070.00	4.91
8	000928	中钢国际	128,300	1,238,095.00	4.81
9	600028	中国石化	163,400	1,039,224.00	4.04
10	300502	新易盛	15,100	1,026,347.00	3.99
11	601857	中国石油	136,300	1,018,161.00	3.96
12	603019	中科曙光	15,400	783,860.00	3.05
13	601000	唐山港	215,300	760,009.00	2.96
14	601881	中国银河	64,500	748,845.00	2.91
15	000065	北方国际	49,800	747,996.00	2.91
16	601618	中国中冶	180,500	716,585.00	2.79
17	002230	科大讯飞	9,900	672,804.00	2.62
18	601988	中国银行	163,800	640,458.00	2.49
19	601333	广深铁路	133,300	527,868.00	2.05
20	603357	设计总院	46,560	488,880.00	1.90
21	601658	邮储银行	81,300	397,557.00	1.55
22	601939	建设银行	61,300	383,738.00	1.49
23	600710	苏美达	44,300	379,208.00	1.47
24	600012	皖通高速	35,300	369,944.00	1.44
25	601398	工商银行	67,400	324,868.00	1.26
26	000938	紫光股份	8,000	254,800.00	0.99
27	002941	新疆交建	5,200	80,496.00	0.31

28	300406	九强生物	1,500	34,995.00	0.14
----	--------	------	-------	-----------	------

#### 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	603019	中科曙光	4,719,471.00	33.00
2	688041	海光信息	4,610,488.35	32.23
3	601186	中国铁建	3,669,815.00	25.66
3	01186	中国铁建	814,873.51	5.70
4	300394	天孚通信	4,350,382.00	30.41
5	601800	中国交建	3,593,622.00	25.12
5	01800	中国交通建设	713,159.29	4.99
6	002051	中工国际	4,185,679.00	29.26
7	601390	中国中铁	3,285,266.00	22.97
7	00390	中国中铁	685,941.86	4.80
8	600970	中材国际	3,586,415.00	25.07
9	300308	中际旭创	3,197,980.00	22.36
10	300502	新易盛	3,121,132.00	21.82
11	000065	北方国际	3,107,473.66	21.73
12	002230	科大讯飞	2,868,601.00	20.06
13	688120	华海清科	2,707,652.49	18.93
14	300418	昆仑万维	2,454,702.00	17.16
15	688072	拓荆科技	2,448,420.73	17.12
16	000928	中钢国际	2,448,378.95	17.12
17	688256	寒武纪	2,440,017.51	17.06
18	000938	紫光股份	2,273,243.00	15.89
19	601857	中国石油	2,121,270.00	14.83
20	601988	中国银行	2,018,889.00	14.11
21	300624	万兴科技	1,983,106.00	13.86
22	00941	中国移动	1,471,090.83	10.28
22	600941	中国移动	239,427.00	1.67
23	600028	中国石化	1,703,050.00	11.91
24	300406	九强生物	1,672,494.00	11.69
25	300002	神州泰岳	1,564,478.00	10.94
26	601658	邮储银行	1,532,243.00	10.71
27	300251	光线传媒	1,514,245.00	10.59
28	601618	中国中冶	1,508,209.00	10.54
29	601398	工商银行	1,460,804.00	10.21
30	002941	新疆交建	1,437,754.00	10.05
31	601939	建设银行	1,427,735.00	9.98
32	300364	中文在线	1,403,650.00	9.81
33	688498	源杰科技	1,311,350.65	9.17
34	002368	太极股份	1,283,192.80	8.97

35	002517	恺英网络	1,264,867.00	8.84
36	300033	同花顺	1,257,567.00	8.79
37	601138	工业富联	1,210,654.00	8.46
38	688111	金山办公	1,142,572.35	7.99
39	001979	招商蛇口	1,128,031.00	7.89
40	002371	北方华创	1,113,628.00	7.79
41	601000	唐山港	1,112,698.00	7.78
42	601881	中国银河	1,089,670.00	7.62
43	600030	中信证券	1,066,203.00	7.45
44	600237	铜峰电子	1,016,734.00	7.11
45	600750	江中药业	1,014,239.00	7.09
46	000063	中兴通讯	998,707.00	6.98
47	300474	景嘉微	987,269.00	6.90
48	603357	设计总院	985,186.00	6.89
49	601628	中国人寿	984,372.00	6.88
50	601995	中金公司	962,419.00	6.73
51	601336	新华保险	945,196.00	6.61
52	601872	招商轮船	927,483.00	6.48
53	688521	芯原股份	904,168.35	6.32
54	601601	中国太保	863,965.00	6.04
55	300299	富春股份	861,204.00	6.02
56	601577	长沙银行	859,985.00	6.01
57	688297	中无人机	842,408.17	5.89
58	002236	大华股份	817,466.00	5.72
59	002558	巨人网络	807,299.00	5.64
60	601117	中国化学	782,593.00	5.47
61	601998	中信银行	782,288.00	5.47
62	00981	中芯国际	759,775.92	5.31
63	601333	广深铁路	754,772.00	5.28
64	688777	中控技术	748,836.00	5.24
65	000977	浪潮信息	743,219.00	5.20
66	688425	铁建重工	729,025.96	5.10
67	601319	中国人保	728,448.00	5.09
68	600026	中远海能	697,490.00	4.88
69	688311	盟升电子	681,807.36	4.77
70	000988	华工科技	678,774.00	4.75
71	601728	中国电信	653,606.00	4.57
72	601328	交通银行	623,974.00	4.36
73	000725	京东方 A	599,632.00	4.19
74	688012	中微公司	588,716.09	4.12
75	300567	精测电子	579,865.00	4.05
76	600150	中国船舶	570,647.00	3.99
77	601318	中国平安	561,846.00	3.93



78	300182	捷成股份	560,278.00	3.92
79	601717	郑煤机	552,975.00	3.87
80	300604	长川科技	545,476.00	3.81
81	600248	陕西建工	536,115.00	3.75
82	002389	航天彩虹	504,214.00	3.53
83	688239	航宇科技	503,427.36	3.52
84	601858	中国科传	500,030.00	3.50
85	300628	亿联网络	498,441.00	3.48
86	000768	中航西飞	492,700.00	3.44
87	002156	通富微电	483,821.00	3.38
88	603444	吉比特	480,618.00	3.36
89	601816	京沪高铁	458,172.00	3.20
90	601666	平煤股份	449,384.00	3.14
91	600508	上海能源	448,859.00	3.14
92	601066	中信建投	447,260.00	3.13
93	600050	中国联通	442,733.00	3.10
94	600862	中航高科	442,237.00	3.09
95	601128	常熟银行	437,797.00	3.06
96	001270	铖昌科技	436,138.00	3.05
97	002439	启明星辰	431,734.00	3.02
98	300174	元力股份	416,402.00	2.91
99	002624	完美世界	415,627.00	2.91
100	600428	中远海特	413,486.00	2.89
101	300260	新莱应材	412,627.00	2.88
102	601360	三六零	406,263.00	2.84
103	601019	山东出版	403,706.00	2.82
104	601975	招商南油	398,775.00	2.79
105	688220	翱捷科技	386,021.94	2.70
106	601611	中国核建	383,989.00	2.68
107	600710	苏美达	381,369.00	2.67
108	600129	太极集团	375,037.00	2.62
109	600316	洪都航空	369,334.00	2.58
110	688372	伟测科技	367,758.22	2.57
111	600012	皖通高速	360,768.00	2.52
112	00883	中国海洋石油	353,763.54	2.47
113	002415	海康威视	353,370.00	2.47
114	000425	徐工机械	352,559.00	2.46
115	002916	深南电路	352,221.00	2.46
116	600633	浙数文化	347,007.00	2.43
117	600863	内蒙华电	343,551.00	2.40
118	600170	上海建工	339,048.00	2.37
119	301117	佳缘科技	334,573.00	2.34
120	601669	中国电建	334,466.00	2.34

121	600528	中铁工业	327,615.00	2.29
122	688327	云从科技	318,047.93	2.22
123	601766	中国中车	314,415.00	2.20
124	601007	金陵饭店	307,414.00	2.15
125	600837	海通证券	302,669.00	2.12
126	688337	普源精电	300,219.14	2.10
127	601008	连云港	299,796.00	2.10
128	002116	中国海诚	298,902.00	2.09
129	002219	新里程	298,560.00	2.09
130	688392	骄成超声	298,506.60	2.09
131	300870	欧陆通	297,473.00	2.08
132	300059	东方财富	296,700.00	2.07
133	600720	祁连山	296,296.00	2.07
134	600603	广汇物流	295,375.00	2.07
135	688234	天岳先进	294,559.19	2.06
136	688205	德科立	294,374.29	2.06
137	601799	星宇股份	294,200.00	2.06
138	600536	中国软件	293,531.00	2.05
139	000625	长安汽车	293,254.00	2.05
140	002920	德赛西威	292,724.00	2.05

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	4,350,011.32	30.41
2	603019	中科曙光	3,984,787.00	27.86
3	300394	天孚通信	3,619,427.00	25.30
4	601800	中国交建	2,206,400.00	15.43
4	01800	中国交通建设	823,757.74	5.76
5	002051	中工国际	2,979,084.00	20.83
6	601186	中国铁建	2,938,606.00	20.54
7	601390	中国中铁	2,137,367.00	14.94
7	00390	中国中铁	674,863.96	4.72
8	300308	中际旭创	2,785,965.00	19.48
9	688120	华海清科	2,606,209.15	18.22
10	300418	昆仑万维	2,517,529.00	17.60
11	300502	新易盛	2,502,306.00	17.49
12	000065	北方国际	2,424,015.00	16.95
13	600970	中材国际	2,399,561.00	16.78
14	688256	寒武纪	2,356,231.38	16.47
15	688072	拓荆科技	2,306,171.40	16.12
16	300624	万兴科技	2,200,092.00	15.38
17	00941	中国移动	1,487,594.65	10.40

17	600941	中国移动	654,106.00	4.57
18	002230	科大讯飞	2,119,999.00	14.82
19	300406	九强生物	2,068,868.00	14.46
20	000938	紫光股份	1,796,408.00	12.56
21	601628	中国人寿	1,609,066.00	11.25
22	300002	神州泰岳	1,596,483.00	11.16
23	300364	中文在线	1,476,134.00	10.32
24	300251	光线传媒	1,425,176.00	9.96
25	002941	新疆交建	1,403,848.00	9.81
26	002517	恺英网络	1,358,439.00	9.50
27	601988	中国银行	1,321,998.00	9.24
28	002368	太极股份	1,311,362.00	9.17
29	000928	中钢国际	1,275,967.00	8.92
30	601728	中国电信	1,259,302.00	8.80
31	601138	工业富联	1,248,197.00	8.73
32	600030	中信证券	1,219,312.00	8.52
33	688498	源杰科技	1,208,624.59	8.45
34	002371	北方华创	1,184,506.00	8.28
35	001979	招商蛇口	1,173,102.00	8.20
36	300033	同花顺	1,172,041.00	8.19
37	601601	中国太保	1,122,835.00	7.85
38	601658	邮储银行	1,117,527.00	7.81
39	601398	工商银行	1,099,834.00	7.69
40	688111	金山办公	1,080,761.60	7.56
41	601857	中国石油	1,048,093.00	7.33
42	600237	铜峰电子	1,012,083.00	7.08
43	600750	江中药业	977,008.00	6.83
44	601939	建设银行	971,755.00	6.79
45	601995	中金公司	939,129.00	6.57
46	601117	中国化学	937,773.00	6.56
47	601336	新华保险	930,837.00	6.51
48	000063	中兴通讯	928,746.00	6.49
49	601872	招商轮船	927,950.00	6.49
50	300474	景嘉微	897,399.00	6.27
51	601577	长沙银行	895,846.00	6.26
52	688521	芯原股份	885,911.07	6.19
53	601318	中国平安	866,420.00	6.06
54	600050	中国联通	856,021.00	5.98
55	601618	中国中冶	854,067.00	5.97
56	300299	富春股份	830,296.00	5.80
57	688297	中无人机	825,203.83	5.77
58	002236	大华股份	809,167.00	5.66
59	002558	巨人网络	802,762.00	5.61

60	601319	中国人保	781,597.00	5.46
61	601668	中国建筑	726,550.00	5.08
62	688777	中控技术	714,300.80	4.99
63	601998	中信银行	710,479.00	4.97
64	688425	铁建重工	679,719.45	4.75
65	000977	浪潮信息	679,680.00	4.75
66	00981	中芯国际	671,463.01	4.69
67	600026	中远海能	668,710.21	4.68
68	688311	盟升电子	666,424.50	4.66
69	600048	保利发展	665,891.00	4.66
70	600325	华发股份	652,726.80	4.56
71	600028	中国石化	639,100.00	4.47
72	601788	光大证券	635,149.00	4.44
73	000988	华工科技	634,118.12	4.43
74	000725	京东方 A	611,508.00	4.28
75	601328	交通银行	600,768.00	4.20
76	600248	陕西建工	585,053.00	4.09
77	300567	精测电子	565,489.00	3.95
78	600150	中国船舶	551,601.00	3.86
79	601456	国联证券	539,371.00	3.77
80	601717	郑煤机	537,029.00	3.75
81	300182	捷成股份	534,931.00	3.74
82	601858	中国科传	527,748.00	3.69
83	000002	万 科 A	521,140.00	3.64
84	688012	中微公司	517,065.08	3.61
85	000001	平安银行	508,875.00	3.56
86	002389	航天彩虹	502,463.00	3.51
87	603444	吉比特	498,449.00	3.48
88	300604	长川科技	497,872.00	3.48
89	300628	亿联网络	493,233.00	3.45
90	000768	中航西飞	492,838.00	3.45
91	601888	中国中免	491,234.00	3.43
92	688239	航宇科技	488,111.40	3.41
93	002156	通富微电	487,379.00	3.41
94	601816	京沪高铁	468,468.00	3.28
95	601066	中信建投	464,184.00	3.25
96	601669	中国电建	463,752.00	3.24
97	601128	常熟银行	462,810.00	3.24
98	600508	上海能源	461,636.00	3.23
99	601666	平煤股份	455,899.00	3.19
100	601166	兴业银行	453,200.00	3.17
101	002939	长城证券	448,797.38	3.14
102	002439	启明星辰	433,775.00	3.03

103	603357	设计总院	430,822.00	3.01
104	601019	山东出版	428,845.00	3.00
105	002624	完美世界	428,012.00	2.99
106	600036	招商银行	425,051.00	2.97
107	300260	新莱应材	419,120.00	2.93
108	600862	中航高科	418,392.00	2.93
109	600428	中远海特	409,836.00	2.87
110	000069	华侨城 A	408,808.00	2.86
111	601975	招商南油	404,248.00	2.83
112	001270	铖昌科技	398,329.00	2.78
113	601360	三六零	393,883.00	2.75
114	601155	新城控股	389,086.00	2.72
115	300174	元力股份	387,200.00	2.71
116	601611	中国核建	374,660.00	2.62
117	600129	太极集团	374,573.00	2.62
118	688220	翱捷科技	371,962.68	2.60
119	000799	酒鬼酒	369,564.00	2.58
120	002415	海康威视	364,183.00	2.55
121	000425	徐工机械	354,606.00	2.48
122	600316	洪都航空	352,473.00	2.46
123	002916	深南电路	345,808.00	2.42
124	600999	招商证券	344,400.00	2.41
125	600170	上海建工	342,720.00	2.40
126	301117	佳缘科技	338,582.00	2.37
127	688372	伟测科技	338,007.37	2.36
128	600863	内蒙华电	337,834.00	2.36
129	00883	中国海洋石油	332,559.40	2.33
130	600633	浙数文化	331,651.00	2.32
131	601100	恒立液压	330,372.00	2.31
132	600383	金地集团	329,280.00	2.30
133	601000	唐山港	319,098.00	2.23
134	000625	长安汽车	319,090.00	2.23
135	600720	祁连山	313,086.00	2.19
136	601766	中国中车	311,202.00	2.18
137	601818	光大银行	311,045.00	2.17
138	601008	连云港	305,424.00	2.14
139	600528	中铁工业	303,362.00	2.12
140	600007	中国国贸	302,771.00	2.12
141	300059	东方财富	302,469.00	2.11
142	601007	金陵饭店	297,579.00	2.08
143	601838	成都银行	296,616.00	2.07
144	002116	中国海诚	295,225.00	2.06
145	002219	新里程	292,947.00	2.05

146	601881	中国银河	290,114.00	2.03
147	600837	海通证券	289,922.00	2.03

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	156,502,365.72
卖出股票收入（成交）总额	146,485,414.50

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。

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 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

无。

##### 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

1、本基金投资的前十名证券中的中国交建，其发行主体为中国交通建设股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚。

投资决策说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 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	32,616.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,572.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,188.88

### 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 (%)
融通红利机会	1,257	7,923.55	3,367,915.21	33.81	6,591,981.72	66.19

主题精选灵活配置混合 A						
融通红利机会主题精选灵活配置混合 C	753	3,376.60	30.23	0.00	2,542,548.14	100.00
合计	2,010	6,220.14	3,367,945.44	26.94	9,134,529.86	73.06

### 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	融通红利机会主题精选灵活配置混合 A	7,998.78	0.08031
	融通红利机会主题精选灵活配置混合 C	3,712.23	0.14600
	合计	11,711.01	0.09367

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通红利机会主题精选灵活配置混合 A	0
	融通红利机会主题精选灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通红利机会主题精选灵活配置混合 A	0
	融通红利机会主题精选灵活配置混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通红利机会主题精选灵活配置混合 A	融通红利机会主题精选灵活配置混合 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 27 日）基金份额总额	611,182,018.16	22,229,294.35
本报告期期初基金份额总额	6,814,646.02	1,021,358.83
本报告期基金总申购份额	6,172,288.39	5,651,392.28
减：本报告期基金总赎回份额	3,027,037.48	4,130,172.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,959,896.93	2,542,578.37

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。



## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

1、2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本公司首席信息官由 Allen Yan（颜锡廉）变更为高翔，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2023 年 3 月 14 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任杜国彦为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

3、2023 年 4 月，经本公司股东会表决通过，由江涛先生担任公司董事，吕秋梅女士不再担任公司董事。

4、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任商小虎为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

5、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任王智鲲为公司财务负责人，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

### 10.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效日以来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，本基金的基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	1	85,224,628.84	28.13	78,518.76	28.46	-
广发证券	1	82,156,370.29	27.12	74,917.40	27.15	-
民生证券	1	69,530,793.98	22.95	61,615.48	22.33	-
海通证券	2	52,428,580.73	17.30	48,299.28	17.50	-
国联证券	1	11,849,048.38	3.91	10,916.73	3.96	-
诚通证券	3	1,798,358.00	0.59	1,656.82	0.60	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	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六个方面：

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

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

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

3、交易单元变更情况

本报告期内交易单元无变更。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	16,000,000.00	100.00	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
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	融通基金关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 7 日
2	融通管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用“融通基金”名义进行诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
3	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
4	关于融通基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开通转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 6 日
5	关于旗下部分开放式基金新增海通证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参与其前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 20 日
6	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	2023 年 2 月 27 日
7	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 14 日

8	融通基金管理有限公司关于公司董事变更情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 14 日
9	关于旗下部分开放式基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
10	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
11	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
12	关于旗下部分开放式基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 18 日
13	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加珠海盈米基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 22 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

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	20230425-20230630	-	3,367,915.21	-	3,367,915.21	26.94
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份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通红利机会主题精选灵活配置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，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查询。

融通基金管理有限公司

2023 年 8 月 25 日