

# 摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：摩根基金管理（中国）有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	7
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 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
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	37
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	46
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	46
7.11 本报告期投资基金情况.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	47
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的情况 .....	48
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>48</b>
<b>10</b>	<b>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 .....	48
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
10.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.6.2	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 .....	50
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>51</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
12.1	备查文件目录 .....	51
12.2	存放地点 .....	51
12.3	查阅方式 .....	52

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)
基金简称	摩根中国世纪混合(QDII)
基金主代码	003243
交易代码	003243
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 日
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	86,656,548.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用定量及定性研究方法，自下而上优选在中国境内及香港、美国等海外市场上市的中国公司，通过严格风险控制，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、各市场资产配置策略</p> <p>本基金综合考虑不同市场的宏观经济环境、增长和通胀背景、不同市场的估值水平和流动性因素、相关公司所处的发展阶段、盈利前景和竞争环境以及其他重要要素将基金资产在中国境内及香港、美国等海外市场之间进行配置。另外，本基金将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，适度的调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例。</p> <p>2、股票投资策略：</p> <p>（1）中国境内市场投资策略</p> <p>本基金将专注投资于影响国民经济的龙头行业、经济转型和产业升级过程中的重点行业和具备成长潜力的新兴行业。</p> <p>（2）香港、美国等海外市场投资策略</p> <p>本基金将结合宏观基本面，包含资金流向等对海外市场上市公司进行初步判断，并结合产业趋势以及公司发展前景自下而上进行布局，从公司商业模式、产品创新及竞争力、主营业务收入来源和区域分布等多维度进行考量，挖掘优质企业。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取多种积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、其他投资策略：包括股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、金融衍生品投资策略、存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	中证中国内地企业 500 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等风险收益水平的基金产品。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和相关销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变

	本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。
--	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	JPMorgan Chase Bank, N.A.
	中文	-	摩根大通银行
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, Ohio 43240, USA
办公地址		-	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001
邮政编码		-	-

注：本基金暂不设境外投资顾问。

### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	am.jpmorgan.com/cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公场所

## 2.6 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-6,893,124.83
本期利润	-7,933,293.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0905
本期加权平均净值利润率	-6.53%
本期基金份额净值增长率	-6.59%
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	7,867,315.21
期末可供分配基金份额利润	0.0908
期末基金资产净值	112,560,505.12
期末基金份额净值	1.2989
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	29.89%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.01%	0.83%	2.02%	0.62%	-2.01%	0.21%
过去三个月	-7.12%	0.93%	-3.79%	0.56%	-3.33%	0.37%
过去六个月	-6.59%	1.05%	-1.23%	0.59%	-5.36%	0.46%
过去一年	-17.26%	1.21%	-7.81%	0.72%	-9.45%	0.49%
过去三年	-26.82%	1.47%	-2.34%	0.81%	-24.48%	0.66%
自基金合同生效	29.89%	1.29%	24.64%	0.73%	5.25%	0.56%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

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

摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2016 年 11 月 11 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 11 日，图示的时间段为合同生效日至本报告期末。

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

因中证指数公司于 2020 年 7 月 13 日起将“中证中国内地企业 400 指数”修订为“中证中国内地企业 500 指数”，本基金的业绩比较基准自同日起由“中证中国内地企业 400 指数×60%+中债总指数收益率×40%”变更为“中证中国内地企业 500 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%”。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

摩根基金管理（中国）有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成



立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。2023 年 1 月 19 日，经中国证监会批准，本公司原股东之一上海国际信托有限公司将其持有的本公司 51% 股权，与原另一股东 JPMorgan Asset Management (UK) Limited 将其持有的本公司 49% 股权转让给摩根资产管理控股公司(JPMorgan Asset Management Holdings Inc.)，从而摩根资产管理控股公司取得本公司全部股权。2023 年 4 月 10 日，基金管理人的名称由“上投摩根基金管理有限公司”变更为“摩根基金管理（中国）有限公司”。截至 2023 年 6 月底，公司旗下运作的基金共有八十七只，均为开放式基金，分别是：摩根中国优势证券投资基金、摩根货币市场基金、摩根阿尔法混合型证券投资基金、摩根双息平衡混合型证券投资基金、摩根成长先锋混合型证券投资基金、摩根内需动力混合型证券投资基金、摩根亚太优势混合型证券投资基金(QDII)、摩根双核平衡混合型证券投资基金、摩根中小盘混合型证券投资基金、摩根纯债债券型证券投资基金、摩根行业轮动混合型证券投资基金、摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、摩根全球新兴市场混合型证券投资基金(QDII)、摩根新兴动力混合型证券投资基金、摩根强化回报债券型证券投资基金、摩根健康品质生活混合型证券投资基金、摩根全球天然资源混合型证券投资基金(QDII)、摩根核心优选混合型证券投资基金、摩根智选 30 混合型证券投资基金、摩根成长动力混合型证券投资基金、摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、摩根双债增利债券型证券投资基金、摩根核心成长股票型证券投资基金、摩根民生需求股票型证券投资基金、摩根纯债丰利债券型证券投资基金、摩根天添盈货币市场基金、摩根天添宝货币市场基金、摩根安全战略股票型证券投资基金、摩根卓越制造股票型证券投资基金、摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、摩根智慧互联股票型证券投资基金、摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、摩根新兴服务股票型证券投资基金、摩根医疗健康股票型证券投资基金、摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、摩根全球多元配置证券投资基金(QDII-FOF)、摩根安通回报混合型证券投资基金、摩根丰瑞债券型证券投资基金、摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、摩根安隆回报混合型证券投资基金、摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、摩根富时发达市场 REITs 指数型证券投资基金(QDII)、摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、摩根安裕回报混合型证券投资基金、摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金(QDII)、摩根核心精选股票型证券投资基金、摩根动力精选混合型证券投资基金、摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)、摩根领先优选混合型证券投资基金、摩根日本精选股票型证券投资基金(QDII)、摩根锦程均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根瑞益纯债债券型证券投资基金、摩根慧选成长股票型证券投资基金、摩根瑞泰 38 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根锦程稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、摩根

研究驱动股票型证券投资基金、摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、摩根瑞盛 87 个月定期开放债券型证券投资基金、摩根慧见两年持有期混合型证券投资基金、摩根远见两年持有期混合型证券投资基金、摩根安享回报一年持有期债券型证券投资基金、摩根行业睿选股票型证券投资基金、摩根优势成长混合型证券投资基金、摩根安荣回报混合型证券投资基金、摩根中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、摩根景气甄选混合型证券投资基金、摩根均衡优选混合型证券投资基金、摩根中证沪港深科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、摩根月月盈 30 天滚动持有发起式短债债券型证券投资基金、摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、摩根全景优势股票型证券投资基金、摩根沃享远见一年持有期混合型证券投资基金、摩根鑫睿优选一年持有期混合型证券投资基金、摩根博睿均衡一年持有期混合型基金中基金(FOF)、摩根中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、摩根慧享成长混合型证券投资基金、摩根瑞享纯债债券型证券投资基金、摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金、摩根沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、摩根标普 500 指数型发起式证券投资基金(QDII)、摩根锦颐养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、摩根海外稳健配置混合型证券投资基金(QDII-FOF)、摩根时代睿选股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王丽军	本基金基金经理	2016-11-11	-	16 年	王丽军女士曾任深圳永泰软件公司任项目实施专员，大公国际资信评估公司任行业评级部经理，东吴基金管理公司行业研究员，申万巴黎基金公司行业研究员。2009 年 10 月起加入摩根基金管理（中国）有限公司（原上投摩根基金管理有限公司），历任行业专家/基金经理助理，现任基金经理。

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.王丽军女士为本基金首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日期。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

## 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

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

## 4.4 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

今年上半年市场波动很大，一季度大家对国内经济恢复的预期良好，四月份以来，房地产以及国内就业的压力开始出现，居民的收入预期以及企业再投资的意愿降低，对市场情绪形成大的压制，整体市场表现不好，除 TMT 几个行业涨幅较大，其余行业表现较弱，香港离岸市场表现更差，本基

金主要持仓确定性股票，包括低估值的油气，有色资源型板块，以及中药、创新药、院内复苏逻辑的医药，以及相对低位的恒生科技股，整个 TMT 板块持仓略少，二季度存在一定的压力。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期摩根中国世纪份额净值增长率为:-6.59%，同期业绩比较基准收益率为:-1.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年经济，我们关注本轮库存周期见底时间，我们认为经济已处于底部区域，经济弱复苏的逻辑将逐渐得到企业盈利的验证，加上多数股票处于相对较低位置，收益相对于风险的性价比比较高。

我们看好如下行业：

国内市场，我们看好中游制造业，包括技术门槛高的高端制造业、高端材料领域、工业自动化、军工以及智能汽车产业链，并持续关注半导体产业、ChatGPT 的出现，将极大提升生产效率，未来也将改变很多行业的格局，我们也重点关注包括运营商、算力基础、应用领域相关公司的投资机会。

香港市场，恒生科技以及创新药调整比较充分，提供了很好的投资机会，另外香港市场波动大，我们核心仓位一直在低估值的板块，包括原油、煤炭、铜铝，以及保险行业，目前市场对经济复苏预期比较弱，相关板块估值都在相对低位，具有一定的安全边际，另外铜铝、原油等资源品价格受美元的影响比较大，叠加长周期供给端的约束，整个资源品的价格或会维持在相对高位，相关公司利润中枢稳定，高分红带来有吸引力的股息率。

消费关注的重点还是在医药行业：重点关注几条线，一是院内复苏线，院内复苏是今年强逻辑，尤其是麻醉领域；二是中药，中药政策扶持或将延续，板块业绩持续性强；三是创新药，板块虽然受市场情绪影响波动比较大，但我们判断今年开始进入创新药商业化大年，因此重点看好。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 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

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	12,202,741.67	18,342,858.20
结算备付金		334,217.14	181,456.95
存出保证金		41,122.33	41,765.98
交易性金融资产	6.4.7.2	100,478,227.23	105,654,747.78
其中：股票投资		100,478,227.23	105,654,747.78

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	5.35
应收股利		380,447.21	-
应收申购款		140,917.88	193,436.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>113,577,673.46</b>	<b>124,414,271.11</b>
<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		4.39	-
应付赎回款		141,207.35	187,380.96
应付管理人报酬		139,500.46	158,226.79
应付托管费		27,900.06	31,645.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	708,556.08	507,461.01
<b>负债合计</b>		<b>1,017,168.34</b>	<b>884,714.09</b>
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	86,656,548.85	88,831,608.95
未分配利润		25,903,956.27	34,697,948.07
<b>净资产合计</b>		<b>112,560,505.12</b>	<b>123,529,557.02</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>113,577,673.46</b>	<b>124,414,271.11</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日,基金份额净值:1.2989 元,基金份额总额:86,656,548.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-6,751,669.91</b>	<b>-19,567,204.89</b>
1.利息收入		39,420.51	37,394.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	39,420.51	37,394.38
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,733,324.07	-27,374,570.08
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-6,969,526.08	-29,445,319.36
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	148,948.44
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,236,202.01	1,921,800.84
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-1,040,169.00	7,757,536.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-30,674.33	-41,480.60
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	13,076.98	53,915.12
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,181,623.92</b>	<b>1,348,442.00</b>
1. 管理人报酬		906,851.93	1,046,717.48
2. 托管费		181,370.38	209,343.56
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	0.17
8. 其他费用	6.4.7.17	93,401.61	92,380.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-7,933,293.83</b>	<b>-20,915,646.89</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-7,933,293.83</b>	<b>-20,915,646.89</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-7,933,293.83</b>	<b>-20,915,646.89</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	88,831,608.95	-	34,697,948.07	123,529,557.02
二、本期期初净资产（基金净值）	88,831,608.95	-	34,697,948.07	123,529,557.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,175,060.10	-	-8,793,991.80	-10,969,051.90
（一）、综合收益总额	-	-	-7,933,293.83	-7,933,293.83
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,175,060.10	-	-860,697.97	-3,035,758.07
其中：1.基金申购款	6,486,196.45	-	2,500,607.60	8,986,804.05
2.基金赎回款	-8,661,256.55	-	-3,361,305.57	-12,022,562.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	86,656,548.85	-	25,903,956.27	112,560,505.12
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	97,313,308.64	-	76,165,098.51	173,478,407.15
二、本期期初净资产（基金净值）	97,313,308.64	-	76,165,098.51	173,478,407.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,220,156.92	-	-24,261,784.83	-30,481,941.75
（一）、综合收益总额	-	-	-20,915,646.89	-20,915,646.89



(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)	-6,220,156.92	-	-3,346,137.94	-9,566,294.86
其中：1.基金申购款	12,978,841.16	-	6,931,270.03	19,910,111.19
2.基金赎回款	-19,198,998.08	-	-10,277,407.97	-29,476,406.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	91,093,151.72	-	51,903,313.68	142,996,465.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王琼慧，主管会计工作负责人：王敏，会计机构负责人：俞文涵

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)(原名为上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)，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[2016]681号《关于准予上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)注册的批复》核准，由摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司，已于2023年4月10日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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275,146,227.73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(2016)第1412号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)基金合同》于2016年11月11日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为275,184,502.24份基金份额，其中认购资金利息折合38,274.51份基金份额。本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行。

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

根据《摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金 (QDII)基金合同》和《摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金 (QDII)招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。以人民币计价并进行认购/申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；以美元计价并进行认购/申购、赎回的份额类别，称为美元份额，美元份额又分为美元现钞份额和美元现汇份额。本基金对人民币份额、美元现钞份额和美元现汇份额分别设置代码，分别公布基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金 (QDII)基金合同》的有关规定，本基金主要投资于：国内依法发行上市的股票、存托凭证、债券、货币市场工具、股票期权、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具；在香港、美国等海外证券市场(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)挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托基金；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益投资工具；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；法律法规允许的、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(包括 ETF 等)；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。本基金主要投资于在中国境内及香港、美国等海外证券市场(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)上市的中国企业股票，“中国企业”是指满足以下三个条件之一的上市公司：(1) 上市公司注册地在中国(包含中国内地及香港)；(2) 上市公司至少 50% 的主营业务收入或利润来自于中国；(3) 控股公司，其子公司的注册地及主要经营活动在中国。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%，其余资产投资于债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的 0%-3%。其中不低于 80% 的非现金基金资产应投资于本基金所定义的在中国境内及香港、美国等海外证券市场(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)上市的中国企业股票。每个

交易日日终在扣除需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的投资市场包含中国境内及香港、美国等海外市场(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)，其中投资于中国境内市场的比例为 0-90%，投资于香港、美国等海外市场(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)的比例为 5%-50%。根据本基金的基金管理人于 2020 年 9 月 25 日发布的《上投摩根基金管理有限公司关于修改上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)基金合同的公告》，自 2020 年 9 月 25 日起，本基金业绩比较基准由“中证中国内地企业 400 指数 X 60%+中债总指数收益率 X 40%”变更为“中证中国内地企业 500 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%”。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区

税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。对基金从境内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)基金在境内卖出股票按 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	12,202,741.67
等于：本金	12,201,945.50
加：应计利息	796.17
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	12,202,741.67

注：于 2023 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：美元 420.82 元(折合人民币 3,040.76 元)，港币 6.30 元(折合人民币 5.81 元)。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	95,133,847.58	-	100,478,227.23	5,344,379.65
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	95,133,847.58	-	100,478,227.23	5,344,379.65

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	289.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	430,723.36
其中：交易所市场	430,723.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	277,543.39
合计	708,556.08

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	88,831,608.95	88,831,608.95
本期申购	6,486,196.45	6,486,196.45
本期赎回（以“-”号填列）	-8,661,256.55	-8,661,256.55
本期末	86,656,548.85	86,656,548.85

注：申购含转换入份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,347,744.21	19,350,203.86	34,697,948.07
本期利润	-6,893,124.83	-1,040,169.00	-7,933,293.83
本期基金份额交易产生的变动数	-587,304.17	-273,393.80	-860,697.97
其中：基金申购款	1,709,569.77	791,037.83	2,500,607.60
基金赎回款	-2,296,873.94	-1,064,431.63	-3,361,305.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,867,315.21	18,036,641.06	25,903,956.27

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	16,041.36
其他	402.56
合计	39,420.51

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	363,047,394.25
减：卖出股票成本总额	368,651,373.88
减：交易费用	1,365,546.45
买卖股票差价收入	-6,969,526.08

#### 6.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,236,202.01
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	1,236,202.01

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-1,040,169.00



——股票投资	-1,040,169.00
——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	-1,040,169.00

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	13,076.98
合计	13,076.98

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	32,036.02
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	1,728.22
银行费用	130.00
合计	93,401.61

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
摩根基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
摩根大通银行(JPMorgan & Chase Bank, N.A.)	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	906,851.93	1,046,717.48
其中：支付销售机构的客户维护费	345,852.69	401,823.97

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	181,370.38	209,343.56
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.3% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	191,897.65	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	191,897.65	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.22%	-

注：上述基金管理人持有的份额包括基金管理人的高级管理人员、主要业务部门负责人、基金经理根据《基金管理公司绩效考核与薪酬管理指引》的要求，将一定比例的绩效薪酬购买本基金的部分。

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

无。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	2022年1月1日至2022年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	12,199,887.05	19,552.16	17,513,560.22	27,318.43
摩根大通银行	2,854.62	3,424.43	691,020.21	-

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

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

#### **6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

##### **6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

无。

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

无。

#### **6.4.11 利润分配情况**

本报告期本基金未实施利润分配。

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

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

无。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为区域性混合型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于债券型基金和平衡型基金。由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监督和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行管控，并提出内控建议。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行以及境外次托管行摩根大通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，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该比例限制)。

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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

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

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	(其他主要 币种) 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	3,040.76	5.81	-	-	3,046.57
交易性金融资产	-	19,913,716.93	-	-	19,913,716.93
应收股利	-	380,447.21	-	-	380,447.21
<b>资产合计</b>	<b>3,040.76</b>	<b>20,294,169.95</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>20,297,210.71</b>
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
<b>资产负债表 外汇风险敞 口净额</b>	<b>3,040.76</b>	<b>20,294,169.95</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>20,297,210.71</b>
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	美元	港币		其他币种	合计



	折合人民币	折合人民币	(其他主要 币种) 折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产					
银行存款	2,184,459.75	470,826.91	-	-	2,655,286.66
交易性金融资产	-	64,038,673.70	-	-	64,038,673.70
<b>资产合计</b>	<b>2,184,459.75</b>	<b>64,509,500.61</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>66,693,960.36</b>
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
<b>资产负债表 外汇风险敞 口净额</b>	<b>2,184,459.75</b>	<b>64,509,500.61</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>66,693,960.36</b>

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 101	增加约 333
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 101	减少约 333

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，首先通过考察

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及其它权益类证券市值占基金资产的 0%-90%，其余资产投资于债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的 0%-3%。其中不低于 80%的非现金基金资产应投资于本基金所定义的在中国境内及香港、美国等海外证券市场(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)上市的中国企业股票。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	100,478,227.23	89.27	105,654,747.78	85.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	100,478,227.23	89.27	105,654,747.78	85.53

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 603	增加约 651
	业绩比较基准下降 5%	减少约 603	减少约 651

#### 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	100,478,227.23	105,654,747.78
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	100,478,227.23	105,654,747.78

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	100,478,227.23	88.47
	其中：普通股	100,478,227.23	88.47
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,536,958.81	11.04
8	其他各项资产	562,487.42	0.50
9	合计	113,577,673.46	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 19913716.93 元,占净值比例

17.69%。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国	80,564,510.30	71.57
中国香港	19,913,716.93	17.69
合计	100,478,227.23	89.27

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

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
医疗保健	24,572,400.37	21.83
能源	23,837,518.16	21.18
信息技术	17,889,030.86	15.89
基础材料	10,340,590.24	9.19
工业	9,747,935.00	8.66
金融	6,585,344.07	5.85
消费者非必需品	4,203,540.00	3.73
电信服务	3,301,868.53	2.93
合计	100,478,227.23	89.27

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	ZTE Corporati on	中兴通讯	000063	深圳证 券交易 所	中国	95,900.00	4,367,286.00	3.88
			00763	香港证 券交易 所	中国	98,800.00	2,860,276.99	2.54
2	Zijin Mining	紫金矿业	02899	香港证 券交易	中国	350,000.00	3,710,969.50	3.30

	Group Company Limited		601899	上海证券交易所	中国	299,802.00	3,408,748.74	3.03
3	Zhejiang Shuangshuan Driveline Co.,Ltd.	双环传动	002472	深圳证券交易所	中国	115,800.00	4,203,540.00	3.73
4	Humanwell Healthcare (group) Co.,Ltd.	人福医药	600079	上海证券交易所	中国	134,400.00	3,620,736.00	3.22
5	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华	601088	上海证券交易所	中国	114,500.00	3,520,875.00	3.13
6	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石化	600028	上海证券交易所	中国	547,746.00	3,483,664.56	3.09
7	China CSSC Holdings Limited	中国船舶	600150	上海证券交易所	中国	105,000.00	3,455,550.00	3.07
8	Wuhan Huazhong Numerical Control Co.,Ltd.	华中数控	300161	深圳证券交易所	中国	64,284.00	3,440,479.68	3.06
9	Shaanxi Coal Industry Company Limited	陕西煤业	601225	上海证券交易所	中国	189,100.00	3,439,729.00	3.06
10	PetroChina Company Limited	中国石油股份	00857	香港证券交易所	中国	684,000.00	3,418,038.01	3.04
11	Jiangsu Nhwa	恩华药业	002262	深圳证券交易所	中国	110,541.00	3,407,979.03	3.03

	Pharmaceutical Co.,Ltd.			所				
12	Shenzhen Inovance Technology Co.,Ltd.	汇川技术	300124	深圳证券交易所	中国	52,600.00	3,377,446.00	3.00
13	Kpc Pharmaceuticals,Inc	昆药集团	600422	上海证券交易所	中国	162,000.00	3,356,640.00	2.98
14	PetroChina Company Limited	中国石油	601857	上海证券交易所	中国	449,106.00	3,354,821.82	2.98
15	Tianjin Pharmaceutical Da Ren Tang Group Corporation Limited	达仁堂	600329	上海证券交易所	中国	74,649.00	3,350,993.61	2.98
16	Chongqing Taiji Industry (Group) Co.,Ltd.	太极集团	600129	上海证券交易所	中国	56,151.00	3,340,422.99	2.97
17	CNOOC Limited	中国海洋石油	00883	香港证券交易所	中国	323,000.00	3,335,354.85	2.96
18	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co.,Ltd.	科伦药业	002422	深圳证券交易所	中国	111,918.00	3,321,726.24	2.95
19	Tencent Holdings Limited	腾讯控股	00700	香港证券交易所	中国	10,800.00	3,301,868.53	2.93
20	China Pacific Insurance(group) Co.,Ltd.	中国太保	601601	上海证券交易所	中国	126,949.00	3,298,135.02	2.93
21	China	中国人寿	02628	香港证	中国	273,000.00	3,287,209.05	2.92

	Life Insurance Company Limited			券交易所				
22	Zhongman Petroleum And Natural Gas Group Corp.,Ltd.	中曼石油	603619	上海证券交易所	中国	194,151.00	3,285,034.92	2.92
23	Sunresin New Materials Co.,Ltd,Xi'an	蓝晓科技	300487	深圳证券交易所	中国	51,600.00	3,220,872.00	2.86
24	Geovis Technology Co.,Ltd.	中科星图	688568	上海证券交易所	中国	39,283.00	3,165,424.14	2.81
25	SWS Hemodialysis Care Co.,Ltd.	山外山	688410	上海证券交易所	中国	57,701.00	3,029,302.50	2.69
26	Unisplendour Corporation Limited	紫光股份	000938	深圳证券交易所	中国	92,035.00	2,931,314.75	2.60
27	Beijing Relpow Technology Co.,Ltd.	新雷能	300593	深圳证券交易所	中国	51,000.00	1,168,410.00	1.04
28	Haisco Pharmaceutical Group Co.,Ltd.	海思科	002653	深圳证券交易所	中国	48,500.00	1,144,600.00	1.02
29	Zhejiang He Chuan Technology Corporation Limited	禾川科技	688320	上海证券交易所	中国	23,315.00	1,124,249.30	1.00



30	China Spacesat Co.,Ltd.	中国卫星	600118	上海证 券交易 所	中国	38,500.00	1,086,085.00	0.96
31	HIMILE MECHA NICAL SCIENCE AND TECHNO LOGY(S HANDO NG)CO.,L TD.	豪迈科技	002595	深圳证 券交易 所	中国	18,800.00	660,444.00	0.59

## 7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	Bilibili Inc.	09626	13,011,464.11	10.53
2	Shaanxi Coal Industry Company Limited	601225	10,662,634.00	8.63
3	Tencent Holdings Limited	00700	10,213,780.57	8.27
4	Zhongman Petroleum And Natural Gas Group Corp.,Ltd.	603619	8,336,405.00	6.75
5	Yankuang Energy Group Company Limited	600188	8,286,121.61	6.71
6	Guanghui Energy Co.,Ltd.	600256	8,205,387.00	6.64
7	Sunresin New Materials Co.,Ltd,Xi'an	300487	7,867,418.00	6.37
8	Kpc Pharmaceuticals,Inc.	600422	7,768,881.00	6.29
9	ApicHope Pharmaceutical Co.,Ltd.	300723	7,605,675.00	6.16
10	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	601318	7,119,328.00	5.76
11	Beigene,Ltd.	688235	7,102,690.34	5.75
12	Sungrow Power Supply Co.,Ltd.	300274	7,043,250.00	5.70
13	Keymed Biosciences Inc.	02162	7,031,464.66	5.69
14	PetroChina Company Limited	00857	7,020,091.86	5.68

15	Remegen Co.,Ltd.	09995	6,285,211.43	5.09
16	Jiangsu Kanion Pharmaceutical Co.,Ltd.	600557	5,987,885.00	4.85
17	Unisplendour Corporation Limited	000938	5,801,499.49	4.70
18	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co.,Ltd.	600276	5,254,843.80	4.25
19	CMOC Group Limited	03993	4,924,826.40	3.99
20	Haisco Pharmaceutical Group Co.,Ltd.	002653	4,641,252.00	3.76
21	Jiangsu Nhwa Pharmaceutical Co.,Ltd.	002262	4,624,391.00	3.74
22	China Pacific Insurance(group) Co.,Ltd.	601601	4,324,415.00	3.50
23	PetroChina Company Limited	601857	4,306,878.00	3.49
24	Yankuang Energy Group Company Limited	01171	4,292,869.78	3.48
25	Yantai Dongcheng Biochemicals Co.,Ltd.	002675	4,184,500.00	3.39
26	Aluminum Corporation Of China Limited	601600	4,111,996.00	3.33
27	Cosco Shipping Energy Transportation Co.,Ltd.	01138	4,045,220.09	3.27
28	Chongqing Taiji Industry (Group) Co.,Ltd.	600129	4,032,182.00	3.26
29	Xiamen Amoytop Biotech Co.,LTD.	688278	3,893,747.61	3.15
30	Tianjin Pharmaceutical Da Ren Tang Group Corporation Limited	600329	3,866,752.00	3.13
31	Hangzhou Tigermed Consulting Co.,Ltd.	300347	3,822,244.00	3.09
32	Luzhou Laojiao CO.,LTD.	000568	3,795,714.00	3.07
33	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co.,Ltd.	601666	3,772,549.00	3.05
34	China Power International Development Limited	02380	3,770,792.63	3.05
35	China Petroleum & Chemical Corporation	600028	3,738,355.00	3.03
36	Aluminum Corporation Of China Limited	02600	3,733,597.43	3.02
37	China Mobile Limited	00941	3,672,628.67	2.97
38	China Merchants Energy	601872	3,640,469.60	2.95

	Shipping Co.,Ltd.			
39	Shenzhen Sed Industry Co.,Ltd.	000032	3,638,450.00	2.95
40	Gigadevice Semiconductor Inc.	603986	3,592,036.00	2.91
41	The People's Insurance Company (Group) Of China Limited	01339	3,587,261.60	2.90
42	Humanwell Healthcare (group) Co.,Ltd.	600079	3,548,167.00	2.87
43	SWS Hemodialysis Care Co.,Ltd.	688410	3,539,557.14	2.87
44	Iflytek Co.,Ltd.	002230	3,534,662.00	2.86
45	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co.,Ltd.	002422	3,534,024.00	2.86
46	The People's Insurance Company (Group) Of China Limited	601319	3,459,132.00	2.80
47	China CSSC Holdings Limited	600150	3,457,160.59	2.80
48	Geovis Technology Co.,Ltd.	688568	3,413,530.76	2.76
49	Zhongji Innolight CO.,LTD.	300308	3,403,262.00	2.76
50	ZTE Corporation	000063	3,389,115.00	2.74
51	China Shenhua Energy Company Limited	601088	3,365,933.00	2.72
52	Shenzhen Inovance Technology Co.,Ltd.	300124	3,365,868.00	2.72
53	Wuhan Huazhong Numerical Control Co.,Ltd.	300161	3,325,801.00	2.69
54	Hubei Xingfa Chemicals Group Co.,Ltd.	600141	3,122,431.00	2.53
55	Postal Savings Bank Of China Corporation Limited	01658	3,115,582.49	2.52
56	Zhejiang Shuanghuan Driveline Co.,Ltd.	002472	3,098,670.00	2.51
57	Dawning Information Industry Co.,Ltd.	603019	3,094,174.00	2.50
58	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	02318	2,945,547.60	2.38
59	Taiji Computer Corporation Limited	002368	2,929,818.90	2.37
60	Guang Yu Yuan Chinese	600771	2,801,383.00	2.27

	Herbal Medicine Co.,Ltd.			
61	ZTE Corporation	00763	2,773,389.72	2.25
62	Naruida Technology Co.,Ltd.	688522	2,599,971.12	2.10
63	Cosco Shipping Energy Transportation Co.,Ltd.	600026	2,551,130.00	2.07
64	VeriSilicon Microelectronics(Shanghai) Co.,Ltd.	688521	2,501,713.43	2.03

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

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Limited	00700	15,972,113.51	12.93
2	Bilibili Inc.	09626	10,755,940.87	8.71
3	Guanghui Energy Co.,Ltd.	600256	10,371,944.42	8.40
4	CMOC Group Limited	03993	8,726,564.67	7.06
5	Zhongman Petroleum And Natural Gas Group Corp.,Ltd.	603619	7,946,168.84	6.43
6	Yankuang Energy Group Company Limited	600188	7,424,976.25	6.01
7	ApicHope Pharmaceutical Co.,Ltd.	300723	7,089,927.30	5.74
8	Beigene,Ltd.	688235	7,051,174.83	5.71
9	Pingdingshan Tianan Coal Mining Co.,Ltd.	601666	6,858,277.08	5.55
10	Kuaishou Technology	01024	6,851,588.88	5.55
11	Sungrow Power Supply Co.,Ltd.	300274	6,840,441.33	5.54
12	Shaanxi Coal Industry Company Limited	601225	6,791,112.21	5.50
13	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	601318	6,748,236.50	5.46
14	Bilibili Inc.	9626	6,466,949.73	5.24
15	Jiangsu Kanion Pharmaceutical Co.,Ltd.	600557	6,329,350.75	5.12
16	China Merchants Bank Co.,Ltd.	600036	5,677,128.76	4.60
17	Remegen Co.,Ltd.	09995	5,634,084.31	4.56
18	Keymed Biosciences Inc.	02162	5,628,443.79	4.56
19	Postal Savings Bank Of China Corporation Limited	01658	5,620,503.41	4.55
20	Kpc Pharmaceuticals,Inc.	600422	5,269,140.57	4.27
21	Sunresin New Materials Co.,Ltd,Xi'an	300487	5,103,427.36	4.13
22	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co.,Ltd.	600276	4,952,751.90	4.01
23	Xiamen Amoytop Biotech Co.,LTD.	688278	4,951,181.08	4.01
24	Guang Yu Yuan Chinese Herbal Medicine Co.,Ltd.	600771	4,872,818.58	3.94

25	Anhui Gujing Distillery Company Limited	000596	4,865,803.81	3.94
26	Cosco Shipping Energy Transportation Co.,Ltd.	01138	4,531,213.13	3.67
27	Yuexiu Property Company Limited	00123	4,493,410.91	3.64
28	Dongfang Electric Corporation Limited	01072	4,073,669.73	3.30
29	Hangzhou Tigermed Consulting Co.,Ltd.	300347	4,042,847.28	3.27
30	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	02318	4,015,816.80	3.25
31	Luzhou Laojiao CO.,LTD.	000568	3,944,617.21	3.19
32	Yankuang Energy Group Company Limited	01171	3,929,130.22	3.18
33	Yantai Dongcheng Biochemicals Co.,Ltd.	002675	3,901,522.28	3.16
34	Henan Shenhua Coal&power Co.,Ltd.	000933	3,824,462.94	3.10
35	Aluminum Corporation Of China Limited	601600	3,798,250.40	3.07
36	PetroChina Company Limited	00857	3,755,151.63	3.04
37	China Mobile Limited	00941	3,754,966.42	3.04
38	AIA Group Limited	01299	3,749,831.54	3.04
39	Zhongji Innolight CO.,LTD.	300308	3,735,030.50	3.02
40	Postal Savings Bank Of China Corporation Limited	601658	3,677,432.00	2.98
41	Shenzhen Sed Industry Co.,Ltd.	000032	3,669,112.66	2.97
42	China Taiping Insurance Holdings Company Limited	00966	3,609,910.26	2.92
43	Industrial Bank CO.,LTD.	601166	3,555,679.50	2.88
44	The People's Insurance Company (Group) Of China Limited	01339	3,531,405.16	2.86
45	China Power International Development Limited	02380	3,486,158.88	2.82
46	Gigadevice Semiconductor Inc.	603986	3,480,118.61	2.82
47	Jinxin Fertility Group Limited	01951	3,409,484.73	2.76
48	Iflytek Co.,Ltd.	002230	3,338,686.06	2.70
49	CMOC Group Limited	603993	3,327,494.34	2.69
50	The People's Insurance Company (Group) Of China Limited	601319	3,320,491.87	2.69
51	Tongwei Co.,Ltd.	600438	3,252,297.40	2.63
52	China Shenhua Energy Company Limited	01088	3,250,988.01	2.63
53	China Merchants Energy Shipping Co.,Ltd.	601872	3,233,836.94	2.62
54	Aluminum Corporation Of China Limited	02600	3,147,243.23	2.55
55	Haisco Pharmaceutical Group Co.,Ltd.	002653	3,123,896.40	2.53
56	Country Garden Holdings Co. Ltd.	02007	3,121,145.86	2.53
57	CNOOC Limited	00883	3,028,626.47	2.45
58	Taiji Computer Corporation Limited	002368	2,855,577.00	2.31
59	Dawning Information Industry Co.,Ltd.	603019	2,776,303.10	2.25
60	Hubei Xingfa Chemicals Group Co.,Ltd.	600141	2,758,780.97	2.23
61	Zijin Mining Group Company Limited	601899	2,688,435.11	2.18
62	Unisplendour Corporation Limited	000938	2,685,447.25	2.17
63	Cosco Shipping Energy Transportation Co.,Ltd.	600026	2,483,625.50	2.01

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

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	364,515,022.33
卖出收入（成交）总额	363,047,394.25

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

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.11 本报告期投资基金情况

#### 7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，人福医药集团股份有限公司（股票代码 600079）在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。除上述股票外，本基金投资的其余前十名证券的发行主体本期末未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	41,122.33
2	应收清算款	-
3	应收股利	380,447.21
4	应收利息	-
5	应收申购款	140,917.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	562,487.42

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
29,543	2,933.23	191,897.65	0.22%	86,464,651.20	99.78%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	303,932.96	0.3507%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）基金份额总额	275,184,502.24
本报告期期初基金份额总额	88,831,608.95
本报告期基金总申购份额	6,486,196.45
减：本报告期基金总赎回份额	8,661,256.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	86,656,548.85

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

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

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

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

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

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

基金托管人：

无。



### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人未受稽查或处罚，亦未发现管理人的高级管理人员受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，托管人未受稽查或处罚，亦未发现托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
瑞银证券	1	716,320,167.90	98.45%	750,968.14	98.79%	-
CICC HK	1	6,466,949.74	0.89%	5,173.56	0.68%	-
Goldman Sachs International - London	1	3,458,950.76	0.48%	2,967.83	0.39%	-
Instinet Pacific Limited	1	1,316,348.07	0.18%	1,053.08	0.14%	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观

经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

3. 交易单元的选择程序:

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

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

4. 本报告期无新增席位,无注销席位。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC HK	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International - London	-	-	-	-	-	-	-	-
Instinet Pacific Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于上投摩根基金管理有限公司股东及实际控制人变更的公告	基金管理人公司网站及本基金选定的信息披露报纸	2023-01-21
2	上投摩根基金管理有限公司关于董事变更的	同上	2023-02-01

	公告		
3	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2023-04-01
4	上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)暂停申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	同上	2023-04-04
5	关于公司法定名称变更的公告	同上	2023-04-12
6	摩根基金管理(中国)有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	同上	2023-04-12
7	摩根基金管理(中国)有限公司关于董事长变更的公告	同上	2023-04-27
8	摩根基金管理(中国)有限公司关于深圳分公司法定名称变更的公告	同上	2023-05-13
9	摩根基金管理(中国)有限公司关于北京分公司法定名称变更的公告	同上	2023-05-19
10	摩根基金管理(中国)有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2023-06-30

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准本基金募集的文件
- (二) 摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)基金合同
- (三) 摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)托管协议
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 摩根基金管理(中国)有限公司开放式基金业务规则
- (八) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

摩根基金管理（中国）有限公司

二〇二三年八月三十一日