

# 建信恒稳价值混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 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                                | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 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             | 12        |
| 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                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 20        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>44</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 44        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 44        |
| 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       | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 46        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 49        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....    | 49        |
| 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 ..... | 49        |
| 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 ..... | 49        |
| 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 .....    | 49        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 49        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 49        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>50</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 50        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 50        |
| 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 .....      | 50        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>51</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 51        |
| 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 .....      | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 51        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 51        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 51        |
| 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 .....         | 52        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 52        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 53        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>54</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 .....    | 54        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 54        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>54</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 54        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 55        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 55        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 建信恒稳价值混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 建信恒稳价值混合         |
| 基金主代码      | 530016           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2011 年 11 月 22 日 |
| 基金管理人      | 建信基金管理有限责任公司     |
| 基金托管人      | 中国光大银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 15,219,146.29 份  |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制下行风险的基础上，通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值，争取实现长期稳健回报。  |
| 投资策略   | 本基金以追求稳健收益、超越业绩比较基准——三年期定期存款利率为投资目标。因此，本基金投资以获取正的投资收益为首要目标，在基金投资运作过程中，严格控制投资风险是实现投资目标的关键，基金管理人应在控制风险的前提下追求投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 同期三年期银行定期存款利率（税前）   |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，主要投资于相似条件下到期收益率较高的优良债券品种及价值型股票，风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金，属于中等风险和预期收益的证券投资基金产品。                       |

### 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      |      | 建信基金管理有限责任公司                   | 中国光大银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吴曙明                            | 石立平                           |
|         | 联系电话 | 010-66228888                   | 010-63639180                  |
|         | 电子邮箱 | xinxipilu@ccbfund.cn           | shiliping@cebbank.com         |
| 客户服务电话  |      | 400-81-95533      010-66228000 | 95595                         |
| 传真      |      | 010-66228001                   | 010-63639132                  |
| 注册地址    |      | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层    | 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 |
| 办公地址    |      | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层    | 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心        |
| 邮政编码    |      | 100033                         | 100033                        |
| 法定代表人   |      | 孙志晨                            | 李晓鹏                           |

注：1、2022 年 5 月 13 日，建信基金管理有限责任公司发布公告，孙志晨先生于 2022 年 5 月 11 日离任，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务。

2、建信基金管理有限责任公司法定代表人已于 2022 年 7 月 27 日变更为刘军先生。

## 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.ccbfund.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的住所        |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                        |
|--------|--------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 建信基金管理有限责任公司 | 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -10,092,810.29                      |
| 本期利润          | -8,691,542.05                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.5801                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -16.15%                             |
| 本期基金份额净值增长率   | -14.30%                             |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 40,950,161.69                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 2.6907                              |
| 期末基金资产净值      | 56,169,307.98                       |
| 期末基金份额净值      | 3.691                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2022 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 302.26%                             |

注：1、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。

2、期末可供分配利润的计算方法：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（已实现部分相抵未实现部分）。

3、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。

### 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 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①—③ | ②—④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

|            | 值增长率①   | 增长率标准差② | 准收益率③  | 收益率标准差④ |         |       |
|------------|---------|---------|--------|---------|---------|-------|
| 过去一个月      | 8.75%   | 0.93%   | 0.23%  | 0.01%   | 8.52%   | 0.92% |
| 过去三个月      | 3.94%   | 1.02%   | 0.70%  | 0.01%   | 3.24%   | 1.01% |
| 过去六个月      | -14.30% | 1.21%   | 1.39%  | 0.01%   | -15.69% | 1.20% |
| 过去一年       | -11.21% | 1.19%   | 2.83%  | 0.01%   | -14.04% | 1.18% |
| 过去三年       | 72.96%  | 1.34%   | 8.73%  | 0.01%   | 64.23%  | 1.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 302.26% | 1.31%   | 42.42% | 0.01%   | 259.84% | 1.30% |

### 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

建信恒稳价值混合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



注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

### 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

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本 10%。

公司下设权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、国际投资与业务发展部、资产配置及量化投资部、基础设施投资部、交易部、研究部、创新发展部、银行业务部、品牌推广部（二级部）、机构业务部、网络金融业务部、证券公司业务部、投资顾问与客户服务部、办公室、人力资源部、计划财务部、基金会计部、注册登记部、金融科技部、投资风险管理部、风险与合规管理部和审计部，以及北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，并在上海设立了子公司—建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家 资产管理行业的领跑者”。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司旗下有建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信利率债债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信恒久价值混合型证券投资基金、建信货币市场基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金 (FOF)、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金 (FOF)、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信短债债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信

消费升级混合型证券投资基金、建信灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞债券型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信彭博政策性银行债券 1-5 年指数证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数证券投资基金(LOF)、建信优势动力混合型证券投资基金(LOF)、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人(MOM)证券投资基金、建信智能生活混合型证券投资基金、建信中关村产业园封闭式基础设施证券投资基金、建信沃信一年持有期混合型证券投资基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信荣瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智能汽车股票型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信臻选混合型证券投资基金、建信汇益一年持有期混合型证券投资基金、建信卓越成长一年持有期混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信高端医疗股票型

证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、建信裕丰利率债三个月定期开放债券型证券投资基金、建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信鑫怡 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、建信优享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、建信创新驱动混合型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信兴润一年持有期混合型证券投资基金、建信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、建信中证饮料主题交易型开放式指数证券投资基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信利率债策略纯债债券型证券投资基金、建信泓利一年持有期债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信鑫悦 90 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信港股通精选混合型证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、建信中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、建信中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、建信高端装备股票型证券投资基金、建信纳斯达克 100 指数型证券投资基金 (QDII)、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信富时 100 指数型证券投资基金 (QDII)、建信医疗健康行业股票型证券投资基金、建信鑫享短债债券型证券投资基金、建信普泽养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信鑫恒 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、建信兴衡优选一年持

有期混合型证券投资基金共计 154 只证券投资基金, 管理的基金净资产规模共计为 7150.00 亿元。

#### 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 |        |   |
| 潘龙玲 | 本基金的基金经理 | 2021年10月20日     | -    | 10年    | 潘龙玲女士，硕士。2006年8月至2008年4月任北京诺华制药有限公司药品临床研究员；2008年4月至2010年8月任凯维斯医药咨询公司药品临床研发项目经理；2012年3月至2014年5月任安邦资产管理公司研究员；2014年6月加入我公司，任研究员，2016年3月30日至2017年8月28日任建信核心精选混合型证券投资基金的基金经理；2017年7月18日起任建信高端医疗股票型证券投资基金的基金经理。2021年10月20日起任建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金的基金经理。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②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。

#### 4.1.3 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

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。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信恒稳价值混合型证券投资基金基金合同》的规定。

#### 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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过

第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

### 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，宏观环境具有明显的两阶段特征。在宏观经济两阶段转换中，最大的变化是国内局部疫情逐渐进入可控范围，叠加稳增长政策密集发力，微观主体复工复产拉动宏观经济从短期收缩走向疫后复苏。中国制造业和服务业 PMI 连续两个月回升，6 月制造业 PMI 回升至 50.2%、服务业回升至 54.3%，显示经济重新回到扩张区间。但 7 月随着国内局部疫情重新抬头和房地产风险事件，经济复苏趋势收到干扰，7 月制造业 PMI 重新跌破荣枯线至 49%。

回顾组合管理，一些优质稳健类资产在持续调整后已具备较好的配置价值，我们聚焦在具有持续内生增长的行业与公司，优化了这部分的配置；另外，组合增加了先进制造业的配置比例，个股选择上综合考虑了未来景气度的变化、潜在收益空间和估值水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-14.30%，波动率 1.21%，业绩比较基准收益率 1.39%，波动率 0.01%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年展望来看，今年二季度已经确立全年经济压力最大的阶段，经济基本面也在二季度确立全年底点，全年经济中枢形成前低后高的形态。当前影响下半年中国经济基本面的核心因素集中在疫后经济复苏的幅度、持续时间，以及房地产风险化解和处置的有效性上。我们认为，下半年中国经济改善的幅度取决于疫后消费复苏情况、房地产销售投资改善复苏幅度以及中国出口的持续性时间。目前，综合考虑疫后经济复苏的程度、稳增长政策效果的发挥和基数效应等因素，经济增速在上半年同比 2.5% 的基础上将逐渐回升，下半年经济进入 5-5.5% 区间，全年经济增速仍能够达到 4% 左右。

本基金将延续一贯的风格，追求价值与高质量的成长，努力寻找投资机会，尽力为持有人获

得良好的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、风险与合规管理部、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、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

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

#### 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

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在建信恒稳价值混合型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

## 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

## 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《建信恒稳价值混合型证券投资基金 2022 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## § 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：建信恒稳价值混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 14,135,782.95          | 20,762,746.13            |
| 结算备付金      |         | 40,722.99              | 590,290.44               |
| 存出保证金      |         | 57,345.28              | 37,172.42                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 43,877,844.09          | 39,652,664.31            |
| 其中：股票投资    |         | 43,877,844.09          | 39,652,664.31            |
| 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         |            | -                         | -                           |
| 应收股利          |            | -                         | -                           |
| 应收申购款         |            | 2,080.84                  | 5,803.11                    |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | 4,044.98                    |
| 资产总计          |            | 58,113,776.15             | 61,052,721.39               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021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         |            | 813,187.46                | -                           |
| 应付赎回款         |            | 183,931.89                | 5,316.51                    |
| 应付管理人报酬       |            | 65,496.55                 | 75,404.60                   |
| 应付托管费         |            | 10,916.08                 | 12,567.43                   |
| 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          | 6.4.7.9    | 870,936.19                | 864,426.53                  |
| 负债合计          |            | 1,944,468.17              | 957,715.07                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 15,219,146.29             | 13,953,487.10               |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 40,950,161.69             | 46,141,519.22               |
| 净资产合计         |            | 56,169,307.98             | 60,095,006.32               |
| 负债和净资产总计      |            | 58,113,776.15             | 61,052,721.39               |

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.691 元，基金份额总额 15,219,146.29 份。

（2）以下比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：建信恒稳价值混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期                                 | 上年度可比期间                            |
|------------------------|------------|------------------------------------|------------------------------------|
|                        |            | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 |
| <b>一、营业总收入</b>         |            | -8,151,521.80                      | 3,425,788.78                       |
| 1. 利息收入                |            | 74,165.31                          | 69,455.12                          |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 74,165.31                          | 37,625.27                          |
| 债券利息收入                 |            | -                                  | 16,852.67                          |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                  | -                                  |
| 买入返售金融资产收入             |            | -                                  | 14,977.18                          |
| 证券出借利息收入               |            | -                                  | -                                  |
| 其他利息收入                 |            | -                                  | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -9,628,649.76                      | 7,388,221.95                       |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | -9,762,338.57                      | 6,071,551.96                       |
| 基金投资收益                 |            | -                                  | -                                  |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15   | -                                  | 1,085,547.59                       |
| 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   | 133,688.81                         | 231,122.40                         |
| 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   | 1,401,268.24                       | -4,043,831.06                      |
| 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   | 1,694.41                           | 11,942.77                          |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 540,020.25                         | 782,639.03                         |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 399,903.01                         | 444,412.39                         |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 66,650.47                          | 74,068.69                          |
| 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           | 6.4.7.22 | -             | -            |
| 7. 税金及附加            |          | -             | 60.71        |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.23 | 73,466.77     | 264,097.24   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -8,691,542.05 | 2,643,149.75 |
| 减：所得税费用             |          | -             | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -8,691,542.05 | 2,643,149.75 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -             | -            |
| 六、综合收益总额            |          | -8,691,542.05 | 2,643,149.75 |

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：建信恒稳价值混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>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) | 13,953,487.10                         | -      | 46,141,519.22 | 60,095,006.32 |
| 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) | 13,953,487.10                         | -      | 46,141,519.22 | 60,095,006.32 |
| 三、本期增减变动额(减)    | 1,265,659.19                          | -      | -5,191,357.53 | -3,925,698.34 |

|  |                                 |   |               |               |
|--|---------------------------------|---|---------------|---------------|
| 少以“-”号填列)                                |                                 |   |               |               |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | - | -8,691,542.05 | -8,691,542.05 |
| (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)      | 1,265,659.19                    | - | 3,500,184.52  | 4,765,843.71  |
| 其中:1.基金申购款                               | 2,139,372.58                    | - | 5,793,129.92  | 7,932,502.50  |
| 2.基金赎回款                                  | -873,713.39                     | - | -2,292,945.40 | -3,166,658.79 |
| (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)                          | 15,219,146.29                   | - | 40,950,161.69 | 56,169,307.98 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021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)                     | 16,271,128.75 | -      | 48,711,353.42  | 64,982,482.17  |
| 加:会计政策变更                            | -             | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                              | -             | -      | -              | -              |
| 其他                                  | -             | -      | -              | -              |
| 二、本期初净资产(基金净值)                      | 16,271,128.75 | -      | 48,711,353.42  | 64,982,482.17  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -1,843,236.75 | -      | -3,167,313.59  | -5,010,550.34  |
| (一)、综合收益总额                          | -             | -      | 2,643,149.75   | 2,643,149.75   |
| (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) | -1,843,236.75 | -      | -5,810,463.34  | -7,653,700.09  |
| 其中:1. 基金申购款                         | 1,996,744.00  | -      | 6,106,487.44   | 8,103,231.44   |
| 2. 基金赎回款                            | -3,839,980.75 | -      | -11,916,950.78 | -15,756,931.53 |
| (三)、本期向基金份额                         | -             | -      | -              | -              |

|                                |               |   |               |               |
|--------------------------------|---------------|---|---------------|---------------|
| 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、本期末净资产(基金净值)                 | 14,427,892.00 | - | 45,544,039.83 | 59,971,931.83 |

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：

张军红

吴曙明

丁颖

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

建信恒稳价值混合型基金(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[2011]1596号《关于核准建信恒稳价值混合型证券投资基金募集的批复》核准,由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒稳价值混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自2011年10月24日至2011年11月18日止。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868,246,359.39元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第430号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《建信恒稳价值混合型证券投资基金基金合同》于2011年11月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为868,315,781.01份基金份额,其中认购资金利息折合69,421.62份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信恒稳价值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债券、股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、货币市场工具及法律、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的相关规定）。本基金持有的股票、权证市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产净值的 30%—80%；债券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的 20%—70%，其中保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为同期三年期银行定期存款利率（税前）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已

发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

## 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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,762,746.13 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,734.34 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,766,480.47 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 590,290.44 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 292.16 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币

0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 590,582.60 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 37,172.42 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 18.48 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 37,190.90 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,044.98 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 3,734.34 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 292.16 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 18.48 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规

定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 14,135,782.95          |
| 等于：本金          | 14,133,195.55          |
| 加：应计利息         | 2,587.40               |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 定期存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 减：坏账准备         | -                      |

|    |               |
|----|---------------|
| 合计 | 14,135,782.95 |
|----|---------------|

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2022年6月30日 |      |               |              |
|-------------------|-------------------|------|---------------|--------------|
|                   | 成本                | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票                | 39,610,420.83     | -    | 43,877,844.09 | 4,267,423.26 |
| 贵金属投资-金交所<br>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                | 39,610,420.83     | -    | 43,877,844.09 | 4,267,423.26 |

#### 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

## 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<br>2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 136.88            |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 751,832.54        |
| 其中：交易所市场    | 751,832.54        |

|       |            |
|-------|------------|
| 银行间市场 | -          |
| 应付利息  | -          |
| 预提费用  | 118,966.77 |
| 合计    | 870,936.19 |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末          | 13,953,487.10                         | 13,953,487.10 |
| 本期申购          | 2,139,372.58                          | 2,139,372.58  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -873,713.39                           | -873,713.39   |
| 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           | 15,219,146.29                         | 15,219,146.29 |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 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

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|----------------|---------------|---------------|
| 本期期初           | 48,201,307.96  | -2,059,788.74 | 46,141,519.22 |
| 本期利润           | -10,092,810.29 | 1,401,268.24  | -8,691,542.05 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,257,680.69   | -757,496.17   | 3,500,184.52  |
| 其中：基金申购款       | 6,955,677.14   | -1,162,547.22 | 5,793,129.92  |
| 基金赎回款          | -2,697,996.45  | 405,051.05    | -2,292,945.40 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -             |
| 本期末            | 42,366,178.36  | -1,416,016.67 | 40,950,161.69 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |           |
|-----------|---------------------------------------|-----------|
|           | 活期存款利息收入                              | 71,505.13 |
| 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 | 2,166.66                              |           |
| 其他        | 493.52                                |           |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 74,165.31 |
|----|-----------|

#### 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                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -9,762,338.57        |
| 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               | -9,762,338.57        |

##### 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                   |
|------------|----------------------|
|            | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 125,970,538.46       |
| 减：卖出股票成本总额 | 135,340,608.99       |
| 减：交易费用     | 392,268.04           |
| 买卖股票差价收入   | -9,762,338.57        |

##### 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                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 133,688.81                      |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                               |
| 基金投资产生的股利收益   | -                               |
| 合计            | 133,688.81                      |

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | 1,401,268.24                    |
| 股票投资                   | 1,401,268.24                    |
| 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                     | 1,401,268.24                    |

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 1,625.48                        |
| 基金转换费收入 | 68.93                           |
| 合计      | 1,694.41                        |

## 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用     | 24,795.19                             |
| 信息披露费    | 39,671.58                             |
| 证券出借违约金  | -                                     |
| 银行间账户维护费 | 9,000.00                              |
| 合计       | 73,466.77                             |

## 6.4.7.24 分部报告

无。

## 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

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

## 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             |
|------------------------|---------------------|
| 建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）   | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

无。

## 6.4.10.1.2 债券交易

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年1月1日至2022年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 399,903.01                     | 444,412.39                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 119,112.17                     | 141,993.04                          |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年1月1日至2022年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 66,650.47                      | 74,068.69                           |

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无。

**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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                          | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |  | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |  |
|-----------------------------|----------------------------|--|---------------------------------|--|
|                             |                            |  |                                 |  |
| 基金合同生效日（2011年11月22日）持有的基金份额 | -                          |  | -                               |  |
| 报告期初持有的基金份额                 | 1,901,483.45               |  | 1,901,483.45                    |  |
| 报告期内申购/买入总份额                | 1,339,137.42               |  | -                               |  |
| 报告期内因拆分变动份额                 | -                          |  | -                               |  |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额              | -                          |  | -                               |  |
| 报告期末持有的基金份额                 | 3,240,620.87               |  | 1,901,483.45                    |  |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 21.29%                     |  | 13.18%                          |  |

注：基金管理人在本年度申购本基金的交易委托建信基金直销中心办理，费率为1000/笔。

## 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2021年1月1日至2021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    |
| 中国光大银行-活期 | 14,135,782.95              | 71,505.13 | 12,603,430.76                   | 35,587.26 |

注：本基金的活期存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 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(2022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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程  
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督  
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制  
上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理与内控合规委员会、督察长、风险与合规管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和风险与合规管理部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构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。在定期存款和银行间同业市场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产品投资流程，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | -                 | -                   |
| AAA 以下 | -                 | 889,879.95          |
| 未评级    | -                 | -                   |

|    |   |            |
|----|---|------------|
| 合计 | - | 889,879.95 |
|----|---|------------|

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

##### 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

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余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利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 1 年以内                | 1-5 年    | 5 年以上    | 不计息                  | 合计                   |
|------------------------|----------------------|----------|----------|----------------------|----------------------|
| <b>资产</b>              |                      |          |          |                      |                      |
| 银行存款                   | 14,135,782.95        | -        | -        | -                    | 14,135,782.95        |
| 结算备付金                  | 40,722.99            | -        | -        | -                    | 40,722.99            |
| 存出保证金                  | 57,345.28            | -        | -        | -                    | 57,345.28            |
| 交易性金融资产                | -                    | -        | -        | 43,877,844.09        | 43,877,844.09        |
| 衍生金融资产                 | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 买入返售金融资产               | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 债权投资                   | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 应收股利                   | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 应收申购款                  | -                    | -        | -        | 2,080.84             | 2,080.84             |
| 其他资产                   | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 应收证券清算款                | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| <b>资产总计</b>            | <b>14,233,851.22</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>43,879,924.93</b> | <b>58,113,776.15</b> |
| <b>负债</b>              |                      |          |          |                      |                      |
| 卖出回购金融资产款              | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 短期借款                   | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 交易性金融负债                | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 衍生金融负债                 | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 应付清算款                  | -                    | -        | -        | 813,187.46           | 813,187.46           |
| 应付赎回款                  | -                    | -        | -        | 183,931.89           | 183,931.89           |
| 应付管理人报酬                | -                    | -        | -        | 65,496.55            | 65,496.55            |
| 应付托管费                  | -                    | -        | -        | 10,916.08            | 10,916.08            |
| 应付销售服务费                | -                    | -        | -        | -                    | -                    |
| 应付投资顾问费                | -                    | -        | -        | -                    | -                    |

|                          |               |       |       |               |               |
|--------------------------|---------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 应交税费                     | -             | -     | -     | -             | -             |
| 应付利润                     | -             | -     | -     | -             | -             |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 870,936.19    | 870,936.19    |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 1,944,468.17  | 1,944,468.17  |
| 利率敏感度缺口                  | 14,233,851.22 | -     | -     | 41,935,456.76 | 56,169,307.98 |
| 上年度末<br>2021 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                     | 20,762,746.13 | -     | -     | -             | 20,762,746.13 |
| 结算备付金                    | 590,290.44    | -     | -     | -             | 590,290.44    |
| 存出保证金                    | 37,172.42     | -     | -     | -             | 37,172.42     |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -     | 39,652,664.31 | 39,652,664.31 |
| 衍生金融资产                   | -             | -     | -     | -             | -             |
| 买入返售金融资产                 | -             | -     | -     | -             | -             |
| 应收证券清算款                  | -             | -     | -     | -             | -             |
| 应收股利                     | -             | -     | -     | -             | -             |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 5,803.11      | 5,803.11      |
| 其他资产                     | -             | -     | -     | 4,044.98      | 4,044.98      |
| 资产总计                     | 21,390,208.99 | -     | -     | 39,662,512.40 | 61,052,721.39 |
| 负债                       |               |       |       |               |               |
| 卖出回购金融资产款                | -             | -     | -     | -             | -             |
| 短期借款                     | -             | -     | -     | -             | -             |
| 交易性金融负债                  | -             | -     | -     | -             | -             |
| 衍生金融负债                   | -             | -     | -     | -             | -             |
| 应付证券清算款                  | -             | -     | -     | -             | -             |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -     | 5,316.51      | 5,316.51      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 75,404.60     | 75,404.60     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 12,567.43     | 12,567.43     |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | -             | -             |
| 应交税费                     | -             | -     | -     | -             | -             |
| 应付利润                     | -             | -     | -     | -             | -             |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 864,426.53    | 864,426.53    |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 957,715.07    | 957,715.07    |
| 利率敏感度缺口                  | 21,390,208.99 | -     | -     | 38,704,797.33 | 60,095,006.32 |

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

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（上年末：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，无重大外汇风险。

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，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。本基金持有的股票、权证市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产净值的30%—80%；债券、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的20%—70%，其中保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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，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<br>2022年6月30日 |               | 上年度末<br>2021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  | 43,877,844.09     | 78.12         | 39,652,664.31       | 65.98         |
| 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            | 43,877,844.09     | 78.12         | 39,652,664.31       | 65.98         |

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    | 相关风险变量的变动      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|----|----------------|-----------------------------|-------------------|
|    |                | 本期末（2022年6月30日）             | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升<br>5% | 2,672,792.06                | 4,167,898.36      |
|    | 业绩比较基准下降<br>5% | -2,672,792.06               | -4,167,898.36     |

## 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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 43,877,844.09     | 39,652,664.31       |
| 第二层次          | -                 | -                   |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 43,877,844.09     | 39,652,664.31       |

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期

间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 43,877,844.09 | 75.50         |
|    | 其中：股票             | 43,877,844.09 | 75.50         |
| 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      | 14,176,505.94 | 24.39         |
| 8  | 其他各项资产            | 59,426.12     | 0.10          |
| 9  | 合计                | 58,113,776.15 | 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      | -             | -             |
| C  | 制造业      | 35,476,258.94 | 63.16         |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -     |
| E | 建筑业              | -             | -     |
| F | 批发和零售业           | 2,811,753.00  | 5.01  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -     |
| J | 金融业              | -             | -     |
| 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       | 3,014,353.15  | 5.37  |
| 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          | 2,575,479.00  | 4.59  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -             | -     |
| S | 综合               | -             | -     |
|   | 合计               | 43,877,844.09 | 78.12 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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  | 600085 | 同仁堂  | 65,900  | 3,484,792.00 | 6.20         |
| 2  | 600809 | 山西汾酒 | 8,000   | 2,598,400.00 | 4.63         |
| 3  | 300896 | 爱美客  | 3,600   | 2,160,036.00 | 3.85         |
| 4  | 605499 | 东鹏饮料 | 12,200  | 2,084,492.00 | 3.71         |
| 5  | 600521 | 华海药业 | 90,900  | 2,063,430.00 | 3.67         |
| 6  | 000963 | 华东医药 | 43,800  | 1,978,008.00 | 3.52         |
| 7  | 300015 | 爱尔眼科 | 43,500  | 1,947,495.00 | 3.47         |
| 8  | 600557 | 康缘药业 | 129,500 | 1,902,355.00 | 3.39         |
| 9  | 000999 | 华润三九 | 39,800  | 1,791,000.00 | 3.19         |
| 10 | 603369 | 今世缘  | 33,400  | 1,703,400.00 | 3.03         |
| 11 | 002557 | 洽洽食品 | 29,500  | 1,679,435.00 | 2.99         |
| 12 | 300347 | 泰格医药 | 14,500  | 1,659,525.00 | 2.95         |
| 13 | 300725 | 药石科技 | 16,700  | 1,653,133.00 | 2.94         |
| 14 | 600566 | 济川药业 | 55,800  | 1,515,528.00 | 2.70         |
| 15 | 600600 | 青岛啤酒 | 13,900  | 1,444,488.00 | 2.57         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 16 | 002507 | 涪陵榨菜 | 40,100 | 1,384,252.00 | 2.46 |
| 17 | 688131 | 皓元医药 | 9,535  | 1,354,828.15 | 2.41 |
| 18 | 603456 | 九洲药业 | 25,726 | 1,330,034.20 | 2.37 |
| 19 | 603198 | 迎驾贡酒 | 20,000 | 1,302,800.00 | 2.32 |
| 20 | 600129 | 太极集团 | 57,200 | 1,256,684.00 | 2.24 |
| 21 | 300122 | 智飞生物 | 10,874 | 1,207,122.74 | 2.15 |
| 22 | 600702 | 舍得酒业 | 5,700  | 1,162,743.00 | 2.07 |
| 23 | 002001 | 新和成  | 47,500 | 1,083,475.00 | 1.93 |
| 24 | 600422 | 昆药集团 | 84,000 | 1,020,600.00 | 1.82 |
| 25 | 600976 | 健民集团 | 16,300 | 833,745.00   | 1.48 |
| 26 | 000729 | 燕京啤酒 | 67,000 | 647,220.00   | 1.15 |
| 27 | 600763 | 通策医疗 | 3,600  | 627,984.00   | 1.12 |
| 28 | 600519 | 贵州茅台 | 300    | 613,500.00   | 1.09 |
| 29 | 000858 | 五粮液  | 1,300  | 262,509.00   | 0.47 |
| 30 | 000596 | 古井贡酒 | 500    | 124,830.00   | 0.22 |

#### 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  | 300122 | 智飞生物 | 5,038,709.60 | 8.38           |
| 2  | 002557 | 洽洽食品 | 4,688,120.97 | 7.80           |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 4,286,786.00 | 7.13           |
| 4  | 603392 | 万泰生物 | 3,710,606.00 | 6.17           |
| 5  | 600600 | 青岛啤酒 | 3,562,810.00 | 5.93           |
| 6  | 600132 | 重庆啤酒 | 3,499,115.00 | 5.82           |
| 7  | 600702 | 舍得酒业 | 3,406,883.00 | 5.67           |
| 8  | 603259 | 药明康德 | 3,365,762.00 | 5.60           |
| 9  | 605499 | 东鹏饮料 | 3,255,176.00 | 5.42           |
| 10 | 300896 | 爱美客  | 3,170,019.80 | 5.28           |
| 11 | 600809 | 山西汾酒 | 3,168,697.00 | 5.27           |
| 12 | 600085 | 同仁堂  | 3,157,076.34 | 5.25           |
| 13 | 300015 | 爱尔眼科 | 3,150,162.00 | 5.24           |
| 14 | 000999 | 华润三九 | 3,143,370.00 | 5.23           |
| 15 | 600129 | 太极集团 | 2,961,802.00 | 4.93           |
| 16 | 300813 | 泰林生物 | 2,858,200.69 | 4.76           |
| 17 | 600422 | 昆药集团 | 2,694,846.00 | 4.48           |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 2,642,311.00 | 4.40           |
| 19 | 603198 | 迎驾贡酒 | 2,631,005.00 | 4.38           |
| 20 | 000729 | 燕京啤酒 | 2,455,015.00 | 4.09           |
| 21 | 000799 | 酒鬼酒  | 2,369,600.00 | 3.94           |
| 22 | 603799 | 华友钴业 | 2,223,252.00 | 3.70           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 23 | 000739 | 普洛药业 | 2,145,671.00 | 3.57 |
| 24 | 000858 | 五粮液  | 2,091,762.00 | 3.48 |
| 25 | 600557 | 康缘药业 | 2,038,359.00 | 3.39 |
| 26 | 603883 | 老百姓  | 2,008,285.00 | 3.34 |
| 27 | 603233 | 大参林  | 1,943,594.00 | 3.23 |
| 28 | 002867 | 周大生  | 1,867,610.00 | 3.11 |
| 29 | 002727 | 一心堂  | 1,828,778.00 | 3.04 |
| 30 | 000002 | 万科 A | 1,788,650.00 | 2.98 |
| 31 | 000876 | 新希望  | 1,770,354.00 | 2.95 |
| 32 | 600298 | 安琪酵母 | 1,768,797.60 | 2.94 |
| 33 | 002991 | 甘源食品 | 1,753,034.00 | 2.92 |
| 34 | 000963 | 华东医药 | 1,735,321.00 | 2.89 |
| 35 | 600521 | 华海药业 | 1,732,177.00 | 2.88 |
| 36 | 688131 | 皓元医药 | 1,723,069.97 | 2.87 |
| 37 | 300347 | 泰格医药 | 1,673,227.00 | 2.78 |
| 38 | 300601 | 康泰生物 | 1,625,974.93 | 2.71 |
| 39 | 300725 | 药石科技 | 1,618,250.00 | 2.69 |
| 40 | 600887 | 伊利股份 | 1,596,288.00 | 2.66 |
| 41 | 002317 | 众生药业 | 1,591,389.00 | 2.65 |
| 42 | 603027 | 千禾味业 | 1,590,986.40 | 2.65 |
| 43 | 001215 | 千味央厨 | 1,585,780.00 | 2.64 |
| 44 | 603369 | 今世缘  | 1,569,521.00 | 2.61 |
| 45 | 603939 | 益丰药房 | 1,523,431.60 | 2.54 |
| 46 | 600566 | 济川药业 | 1,370,919.00 | 2.28 |
| 47 | 688276 | 百克生物 | 1,354,562.28 | 2.25 |
| 48 | 603127 | 昭衍新药 | 1,306,040.00 | 2.17 |
| 49 | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,304,678.00 | 2.17 |

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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  | 300813 | 泰林生物 | 5,670,199.04 | 9.44            |
| 2  | 600702 | 舍得酒业 | 5,295,860.00 | 8.81            |
| 3  | 603259 | 药明康德 | 4,560,302.72 | 7.59            |
| 4  | 300122 | 智飞生物 | 3,959,121.00 | 6.59            |
| 5  | 603392 | 万泰生物 | 3,824,971.00 | 6.36            |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 3,636,301.76 | 6.05            |
| 7  | 002507 | 涪陵榨菜 | 3,383,091.00 | 5.63            |
| 8  | 600750 | 江中药业 | 3,346,204.00 | 5.57            |
| 9  | 600529 | 山东药玻 | 3,345,703.00 | 5.57            |
| 10 | 300171 | 东富龙  | 3,313,499.00 | 5.51            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 11 | 002557 | 洽洽食品 | 3,278,099.00 | 5.45 |
| 12 | 600132 | 重庆啤酒 | 3,045,853.00 | 5.07 |
| 13 | 002714 | 牧原股份 | 2,746,442.00 | 4.57 |
| 14 | 000568 | 泸州老窖 | 2,412,524.00 | 4.01 |
| 15 | 000799 | 酒鬼酒  | 2,397,319.00 | 3.99 |
| 16 | 000999 | 华润三九 | 2,349,391.00 | 3.91 |
| 17 | 603799 | 华友钴业 | 2,276,674.00 | 3.79 |
| 18 | 600600 | 青岛啤酒 | 2,145,218.00 | 3.57 |
| 19 | 300750 | 宁德时代 | 2,123,652.00 | 3.53 |
| 20 | 000739 | 普洛药业 | 2,039,168.00 | 3.39 |
| 21 | 600422 | 昆药集团 | 1,958,719.00 | 3.26 |
| 22 | 300026 | 红日药业 | 1,942,757.00 | 3.23 |
| 23 | 000729 | 燕京啤酒 | 1,833,990.08 | 3.05 |
| 24 | 000858 | 五粮液  | 1,794,408.00 | 2.99 |
| 25 | 002867 | 周大生  | 1,780,646.00 | 2.96 |
| 26 | 002727 | 一心堂  | 1,774,804.00 | 2.95 |
| 27 | 600129 | 太极集团 | 1,691,212.00 | 2.81 |
| 28 | 300358 | 楚天科技 | 1,677,830.00 | 2.79 |
| 29 | 300601 | 康泰生物 | 1,669,710.00 | 2.78 |
| 30 | 001215 | 千味央厨 | 1,650,202.00 | 2.75 |
| 31 | 603027 | 千禾味业 | 1,645,526.00 | 2.74 |
| 32 | 688202 | 美迪西  | 1,642,190.18 | 2.73 |
| 33 | 300015 | 爱尔眼科 | 1,623,982.41 | 2.70 |
| 34 | 000876 | 新希望  | 1,603,622.00 | 2.67 |
| 35 | 002317 | 众生药业 | 1,526,939.00 | 2.54 |
| 36 | 603198 | 迎驾贡酒 | 1,483,243.00 | 2.47 |
| 37 | 000002 | 万科A  | 1,464,916.00 | 2.44 |
| 38 | 603883 | 老百姓  | 1,438,012.00 | 2.39 |
| 39 | 600887 | 伊利股份 | 1,429,942.00 | 2.38 |
| 40 | 688276 | 百克生物 | 1,425,451.71 | 2.37 |
| 41 | 605337 | 李子园  | 1,411,880.00 | 2.35 |
| 42 | 002991 | 甘源食品 | 1,377,253.00 | 2.29 |
| 43 | 600085 | 同仁堂  | 1,369,521.00 | 2.28 |
| 44 | 603233 | 大参林  | 1,359,022.00 | 2.26 |
| 45 | 603939 | 益丰药房 | 1,304,801.00 | 2.17 |
| 46 | 603127 | 昭衍新药 | 1,283,778.00 | 2.14 |
| 47 | 300896 | 爱美客  | 1,279,061.00 | 2.13 |
| 48 | 600298 | 安琪酵母 | 1,273,584.00 | 2.12 |

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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 | 138,164,520.53 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 125,970,538.46 |

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

#### 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

无。

#### 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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

## 7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

## 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 | 57,345.28 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 2,080.84  |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 59,426.12 |

## 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

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>(%) | 持有份额          | 占总份额比例<br>(%) |
| 2,899        | 5,249.79      | 3,240,637.89 | 21.29         | 11,978,508.40 | 78.71         |

## 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 | 7,501.83  | 0.05        |

## 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

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持

有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                     |                |
|-------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2011 年 11 月 22 日）<br>基金份额总额 | 868,315,781.01 |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 13,953,487.10  |
| 本报告期基金总申购份额                         | 2,139,372.58   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 873,713.39     |
| 本报告期基金拆分变动份额                        | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 15,219,146.29  |

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，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

经本基金管理人建信基金管理有限责任公司 2022 年第一次临时股东会和第六届董事会第五次会议审议通过，自 2022 年 5 月 11 日起，孙志晨先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务。经本基金管理人建信基金管理有限责任公司第六届董事会第五次会议审议通过，自 2022 年 5 月 11 日起，马勇先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案并于 2022 年 5 月 13 日公告。

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

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人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

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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 (%) |    |
| 江海证券   | 1      | 115,586,371.00 | 43.76            | 107,646.04 | 44.20          | -  |
| 方正证券   | 1      | 63,449,674.96  | 24.02            | 58,137.46  | 23.87          | -  |
| 兴业证券   | 1      | 54,273,887.62  | 20.55            | 49,460.17  | 20.31          | -  |
| 中信证券   | 1      | 19,919,783.41  | 7.54             | 18,152.82  | 7.45           | -  |
| 银河证券   | 2      | 10,898,277.00  | 4.13             | 10,149.51  | 4.17           | -  |
| 东方证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国海证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国联证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国泰君安证券 | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 华泰证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 申港证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 申万宏源   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 中金公司   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 中泰证券   | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 中信建投   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

(1) 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人；

3、本基金本报告期内新增中信建投一个交易单元，无剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

### 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 (%) |
| 江海证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 方正证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 兴业证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中信证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 银河证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 东方证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国海证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国联证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国泰君安证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 华泰证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 申港证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 申万宏源   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中金公司   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中泰证券   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中信建投   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

### 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  | 关于新增东吴证券股份有限公司为建信旗下部分产品销售机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2022 年 03 月 14 日 |
| 2  | 关于新增华宝证券股份有限公司为建               | 指定报刊和/或公司网  | 2022 年 01 月 26 日 |

|   |                                  |             |                  |
|---|----------------------------------|-------------|------------------|
|   | 信旗下部分产品销售机构的公告                   | 站           |                  |
| 3 | 关于新增天风证券股份有限公司为建信旗下部分公募基金销售机构的公告 | 指定报刊和/或公司网站 | 2022 年 01 月 25 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

单位：份

| 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              | 2022 年 02 月 15 日-2022 年 06 月 30 日 | 1,901,483.45 | 1,339,137.42 | -    | 3,240,620.87 | 21.29    |
| 产品特有风险  |                |                                   |              |              |      |              |          |
| <p>本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况,可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险,敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制,持续做好基金流动性风险的管控工作,审慎评估大额申赎对基金运作的影响,采取有效措施切实保护持有人合法权益。</p> |                |                                   |              |              |      |              |          |

### 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

- 1、中国证监会批准建信恒稳价值混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信恒稳价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信恒稳价值混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信恒稳价值混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

## 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。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2022 年 8 月 30 日